

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

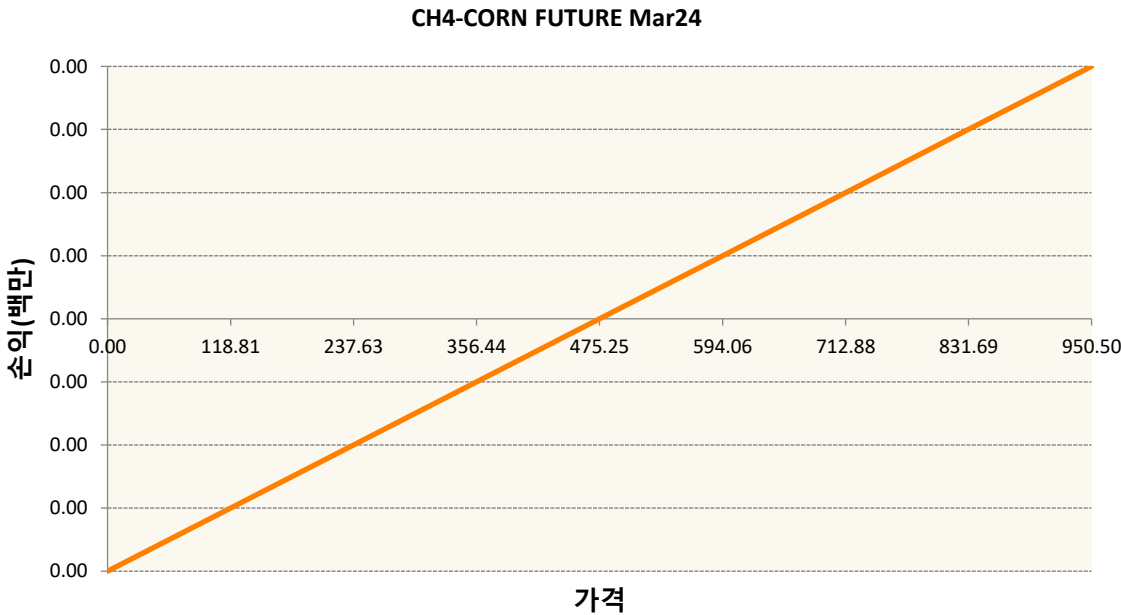
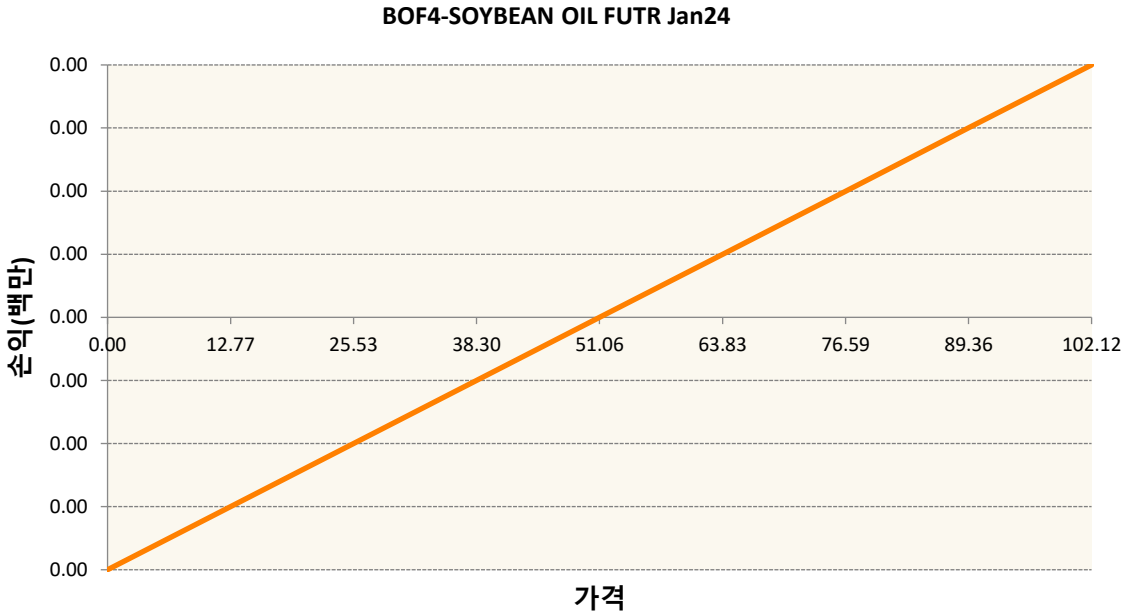
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

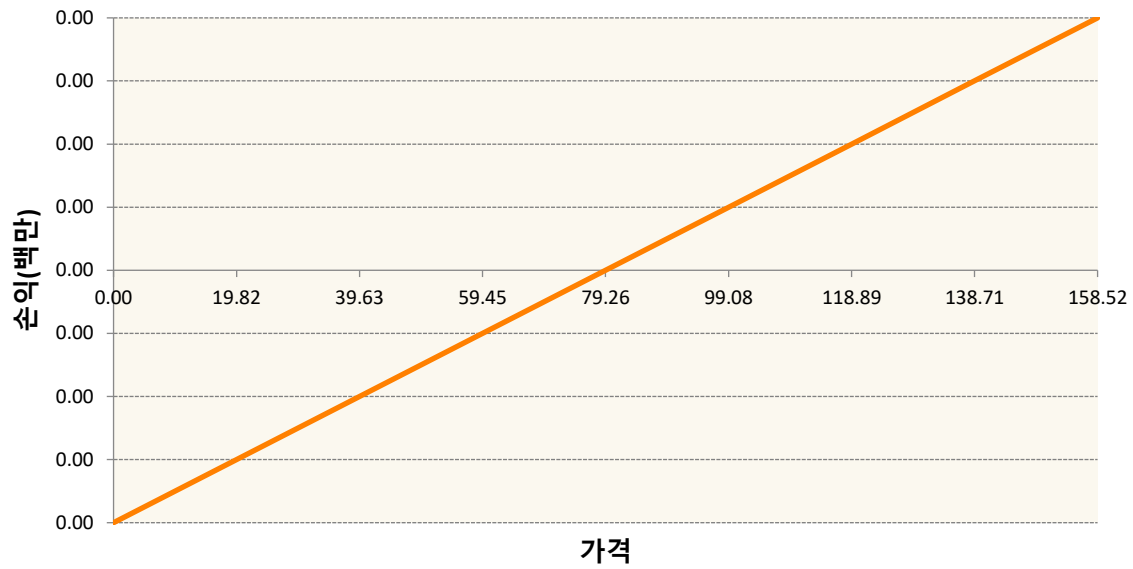
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	39	0	39	장내
누계	유가증권	선물	4,873	0	4,873	
누계	통화	선물	0	543	-543	장내

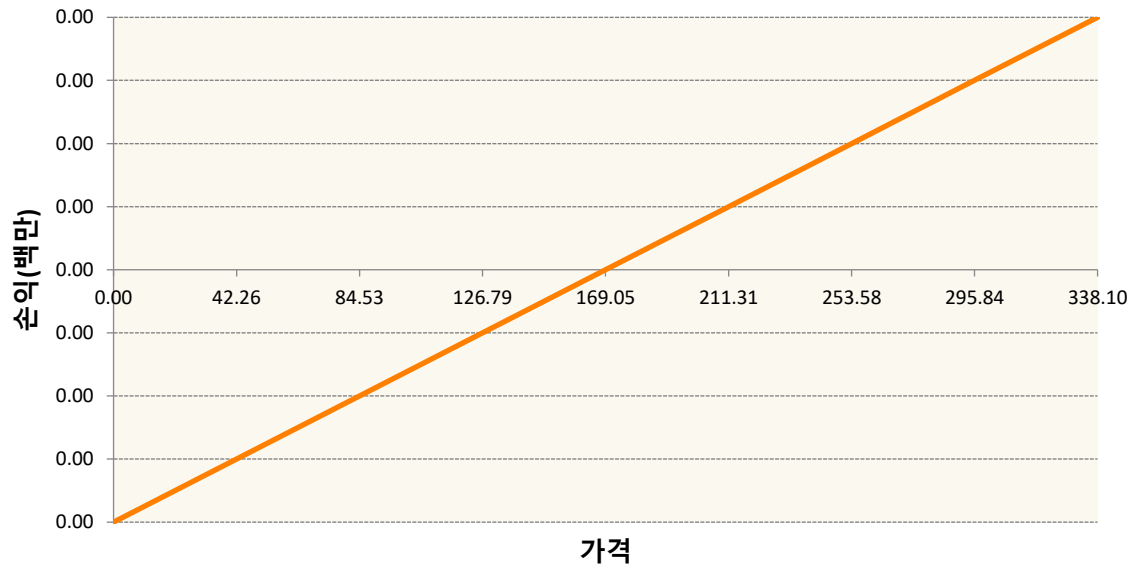
2. 만기시점의 손익구조



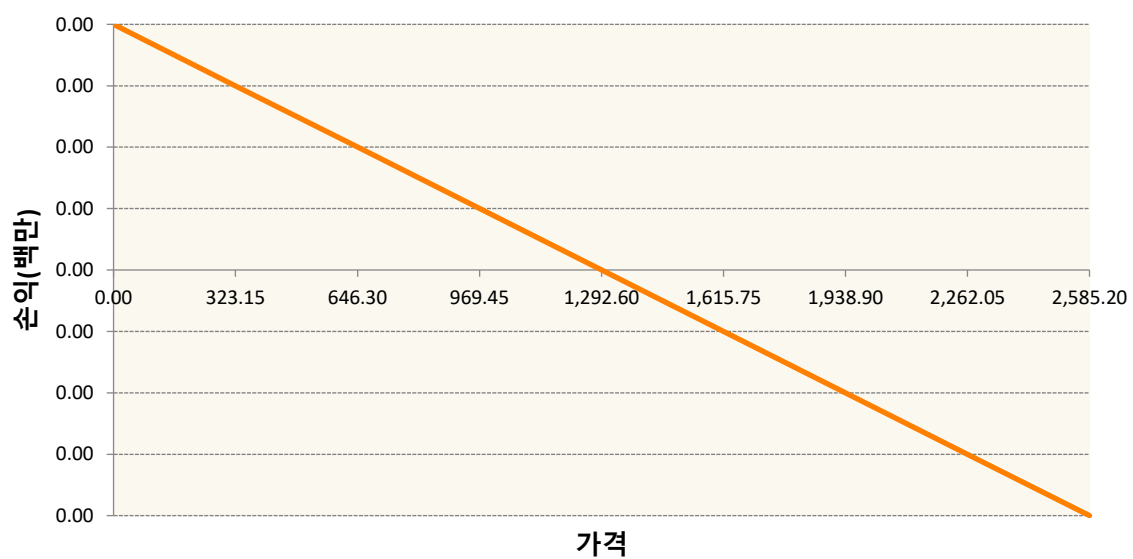
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



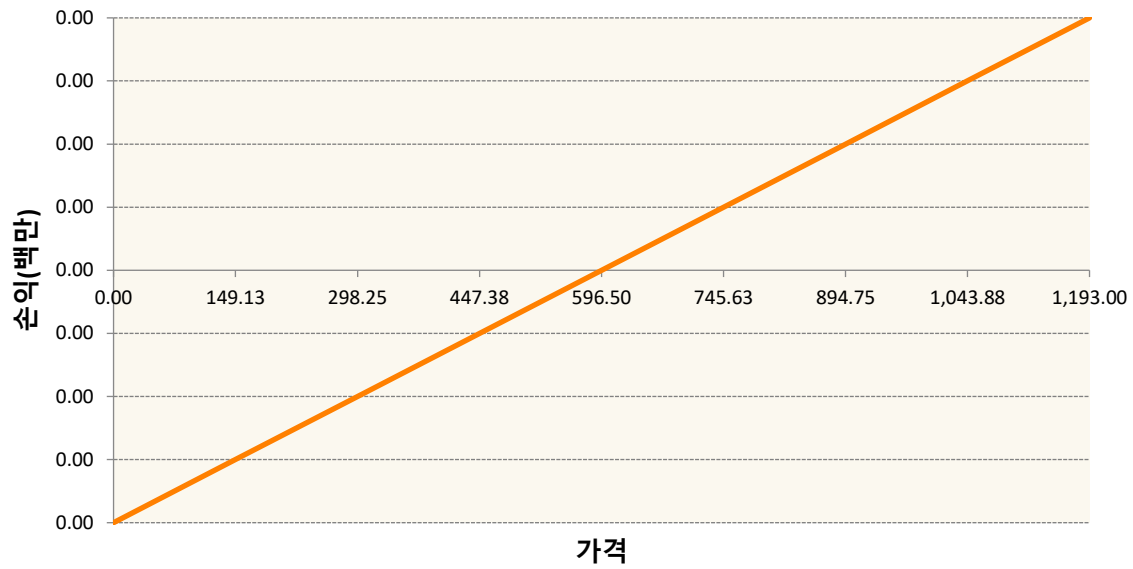
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



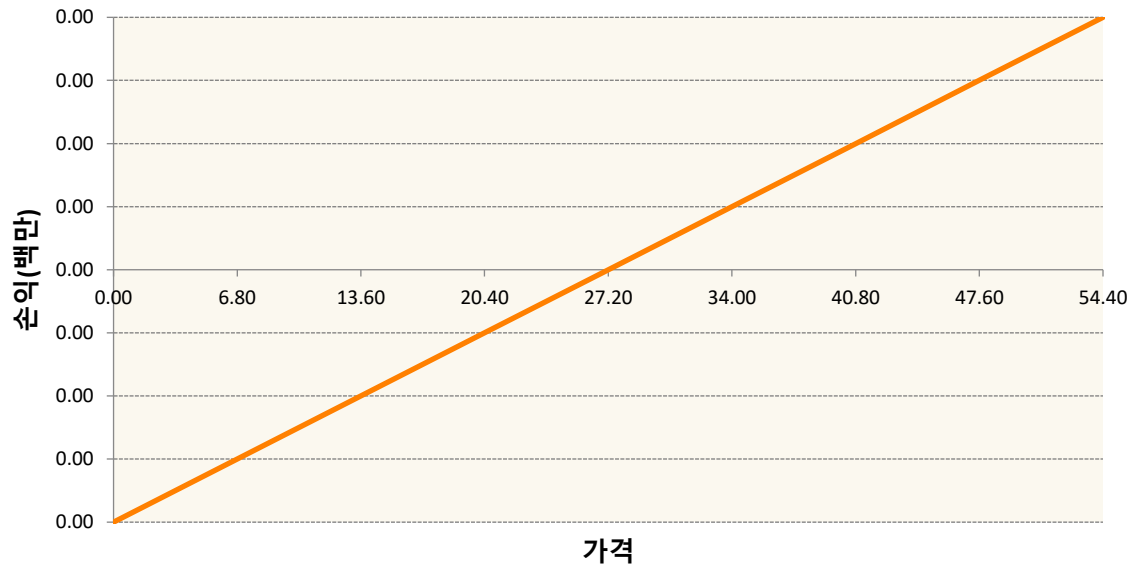
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



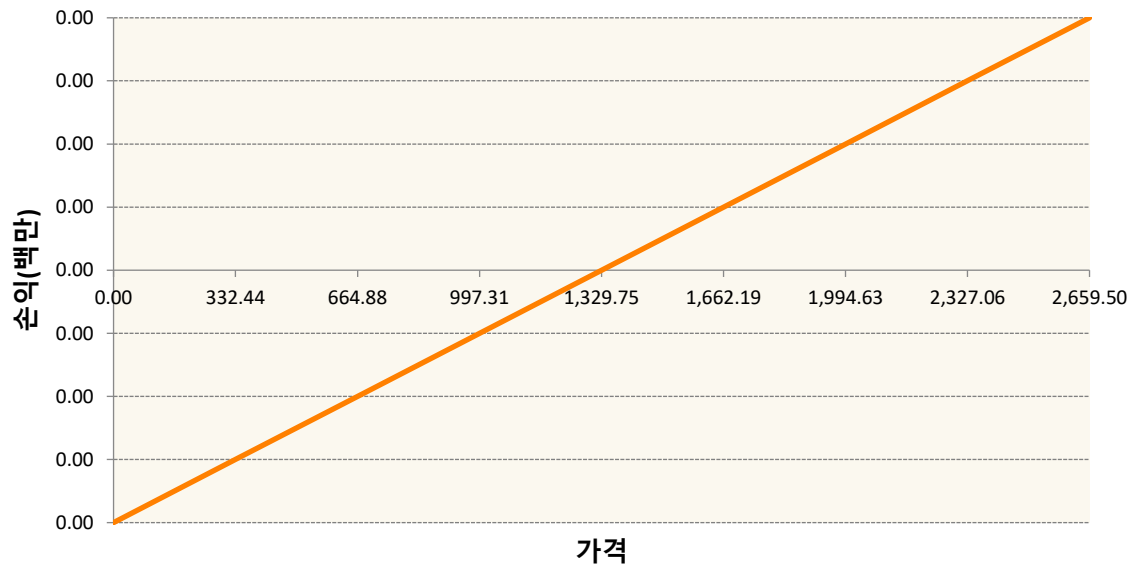
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



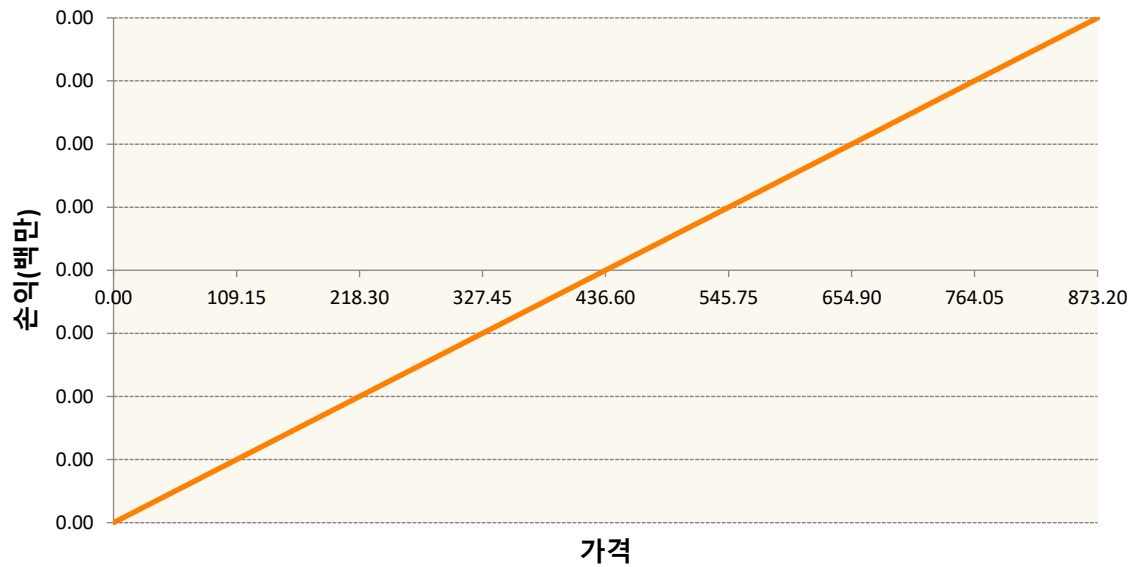
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



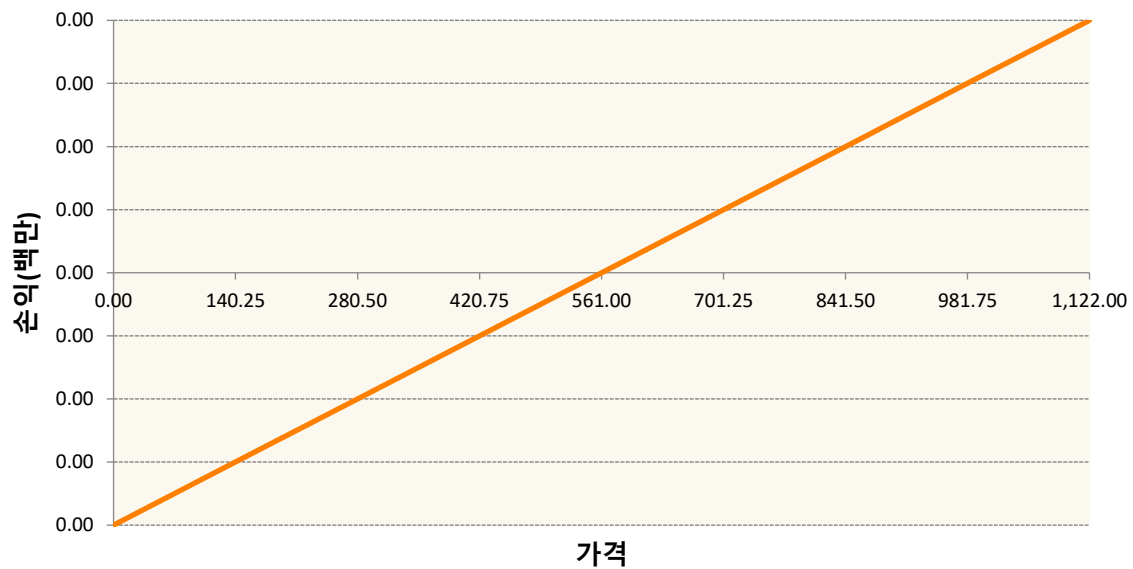
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



SMF4-SOYBEAN MEAL FUTR Jan24



WH4-WHEAT FUTURE(CBT) Mar24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

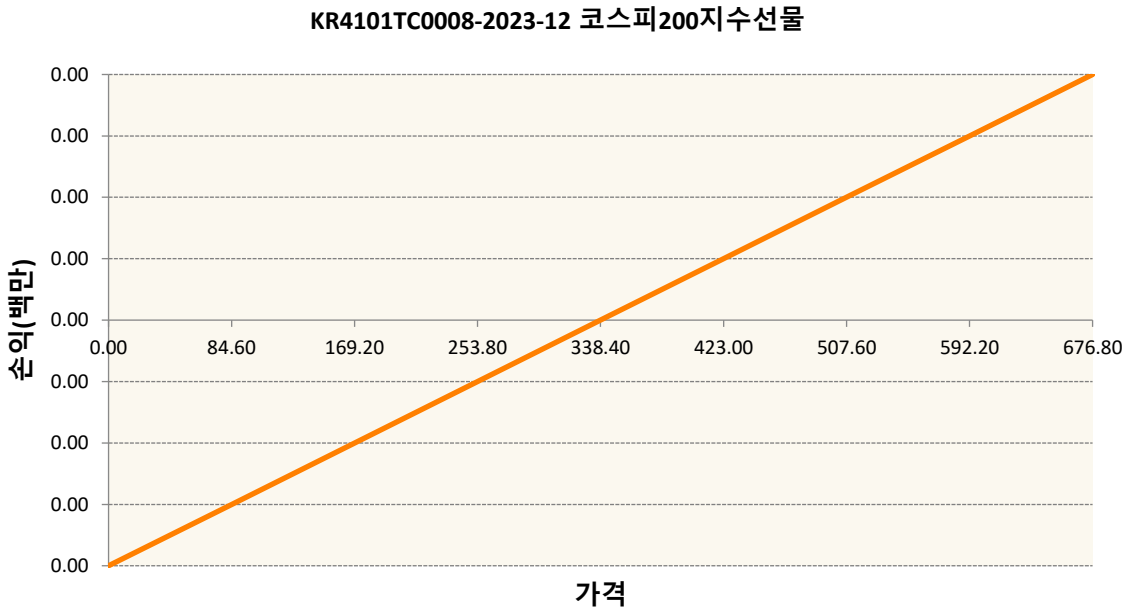
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	85	0	85	장내
누계	유가증권	선물	1,861	0	1,861	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				149
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	99	99	99	99	99	99	99
8.00%	149	149	149	149	149	149	149

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,903	0	3,903	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래230314	317
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

285

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

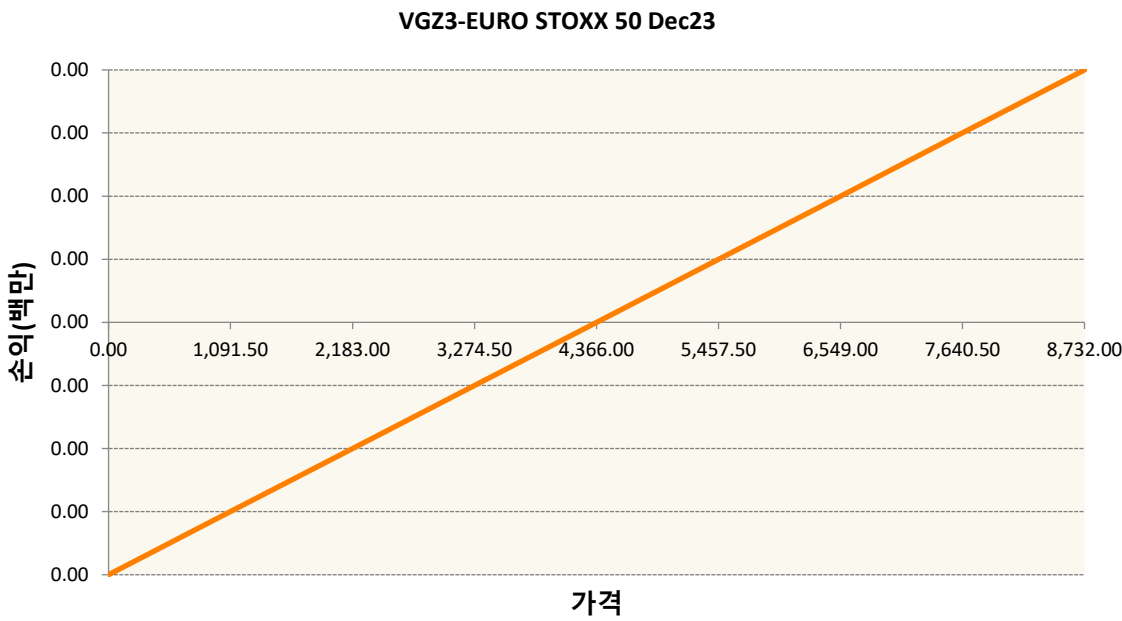
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	931	0	931	
누계	통화	선도	212	0	212	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E	17
VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23	74

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

71

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

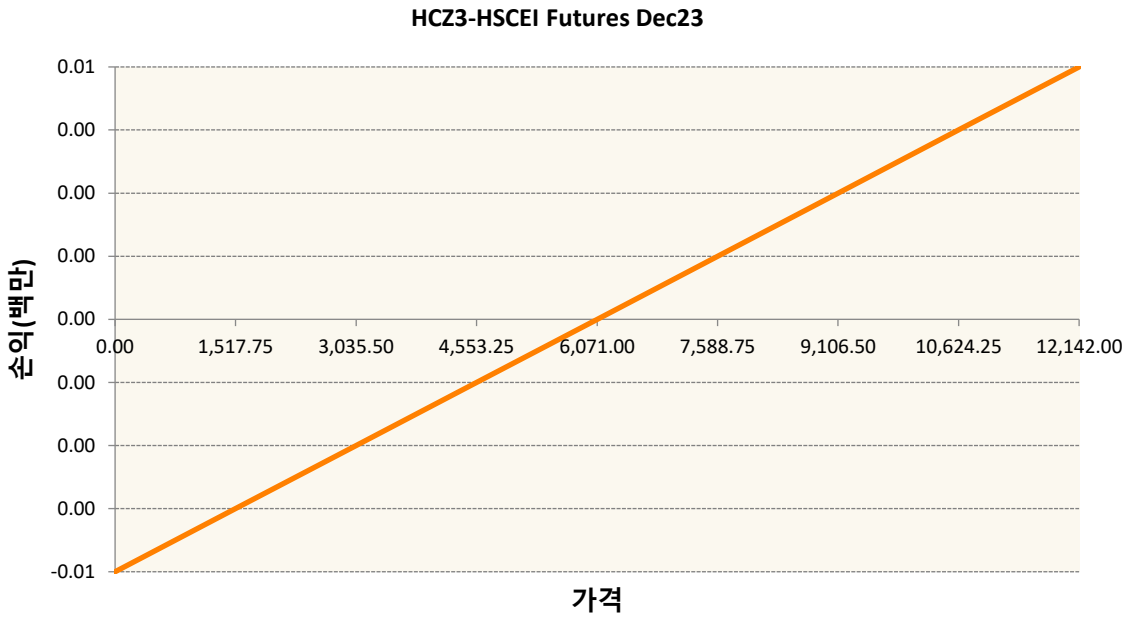
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,159	0	1,159	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ3	HSCEI Futures Dec23	93
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

136

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

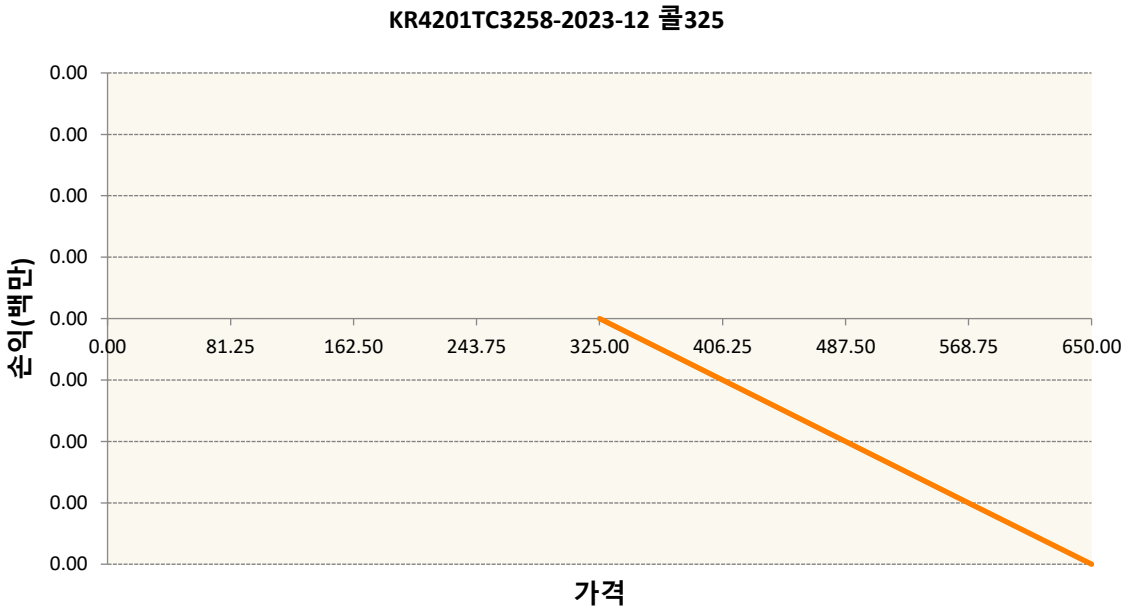
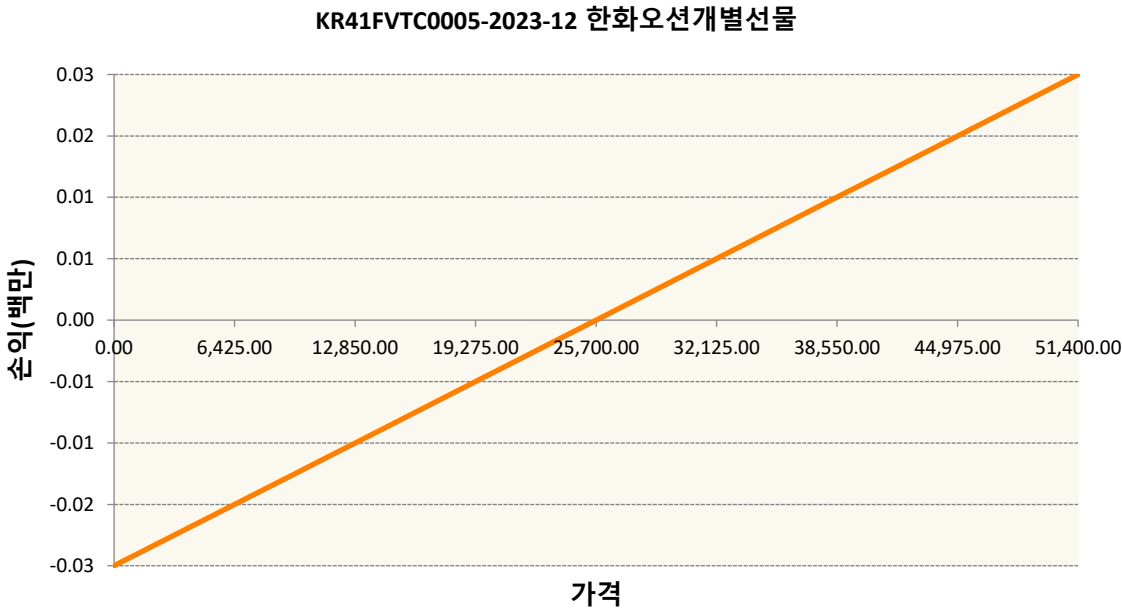
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	33	0	33	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,151	-51,151	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 655.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line represents the relationship, starting at a price of 327.50 with zero profit/loss and ending at a price of 655.00 with a profit/loss of -0.00.

가격	손익(백만)
327.50	0.00
655.00	-0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 650.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (0, 0) and ending at (325, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in this range.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
325.00	0.00

(단위:백만원)

KR41FVTC0005		2023-12 한화오션개별선물					3	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	3
KR4201TC3258		2023-12 콜325					2,795	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,613	1,576	1,535	1,491	1,445	1,396	1,346
-5.33%	1,374	1,314	1,253	1,191	1,129	1,067	1,004
-2.67%	884	821	757	693	629	564	500
0%	142	98	50	0	-53	-107	-163
2.67%	-765	-786	-813	-843	-878	-916	-957
5.33%	-1,746	-1,753	-1,764	-1,779	-1,798	-1,820	-1,846
8.00%	-2,750	-2,752	-2,755	-2,761	-2,769	-2,780	-2,795

KR4201TC3274

2023-12 콜327.5

438

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	231	226	220	214	208	201	193
-5.33%	201	192	183	174	164	155	145
-2.67%	134	124	113	103	92	82	71
0%	26	18	9	0	-9	-19	-28
2.67%	-114	-118	-123	-129	-136	-143	-150
5.33%	-269	-270	-273	-276	-279	-284	-289
8.00%	-429	-429	-430	-432	-433	-436	-438

KR4301TC3257

2023-12 풋325

405

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-341	-349	-359	-370	-381	-393	-405
-5.33%	-155	-170	-184	-199	-214	-229	-244
-2.67%	-30	-45	-61	-76	-92	-107	-123
0%	34	24	12	0	-13	-26	-39
2.67%	59	54	47	40	32	22	13
5.33%	66	64	61	58	53	48	41
8.00%	67	67	66	64	62	60	56

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

3,782

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,900	0	1,900	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	4,483	0	4,483	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	17,113	0	17,113	
누계	통화	선도	0	24,470	-24,470	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E		589
FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E		502
FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E		185
FXW213DB7 KRW/USD 30-11-23E		47
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E		635
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,032

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

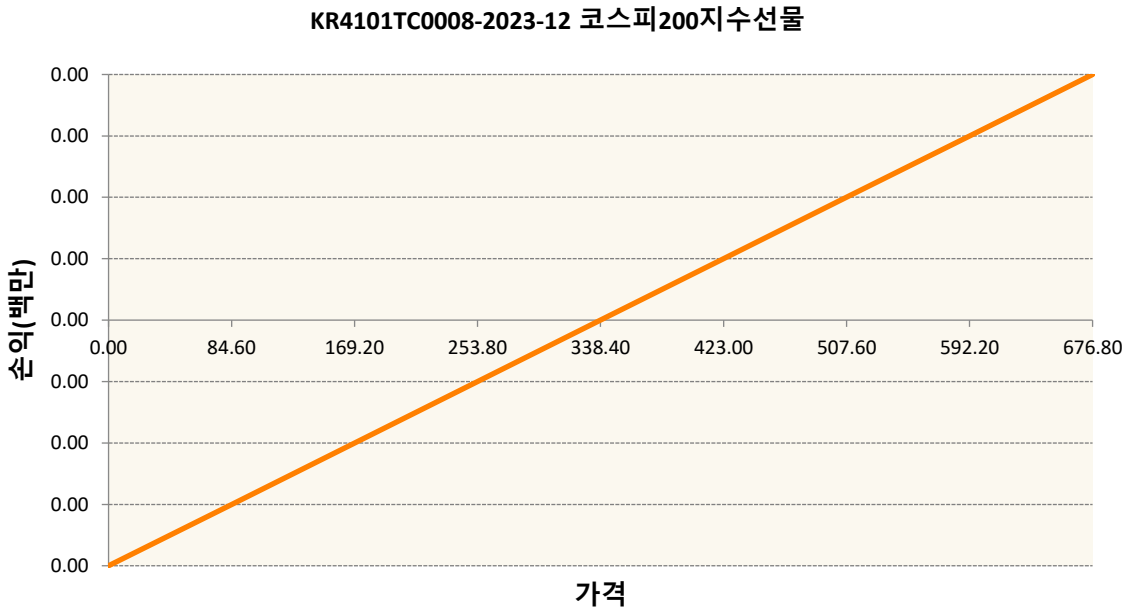
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	677	0	677	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008			2023-12 코스피200지수선물				54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

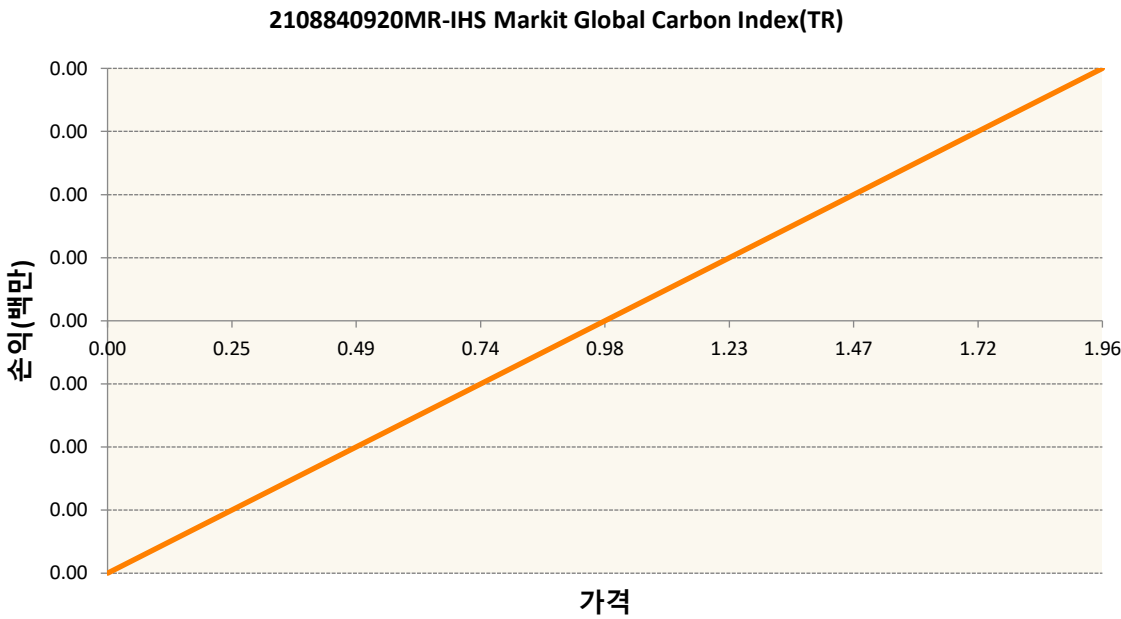
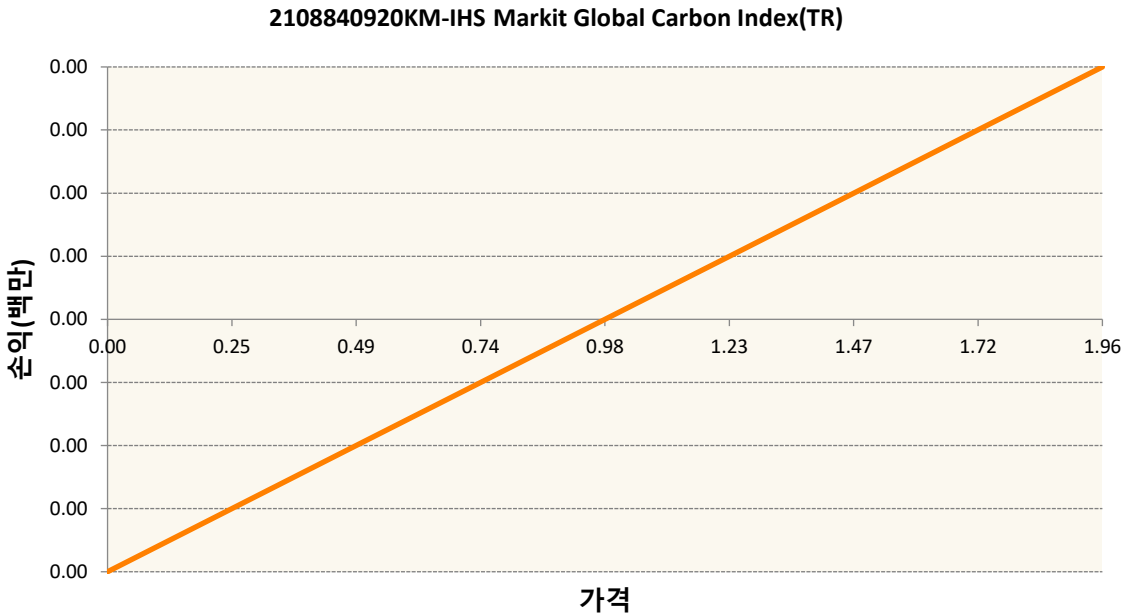
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

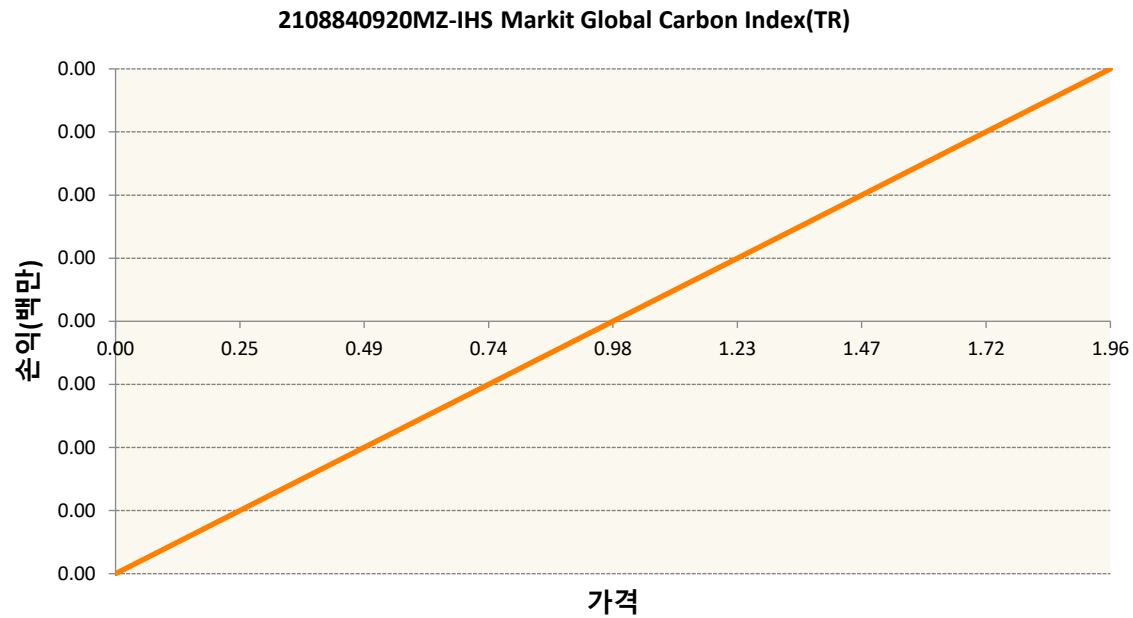
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	17,356	0	17,356	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		993
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		199
2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR)		199

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,773

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

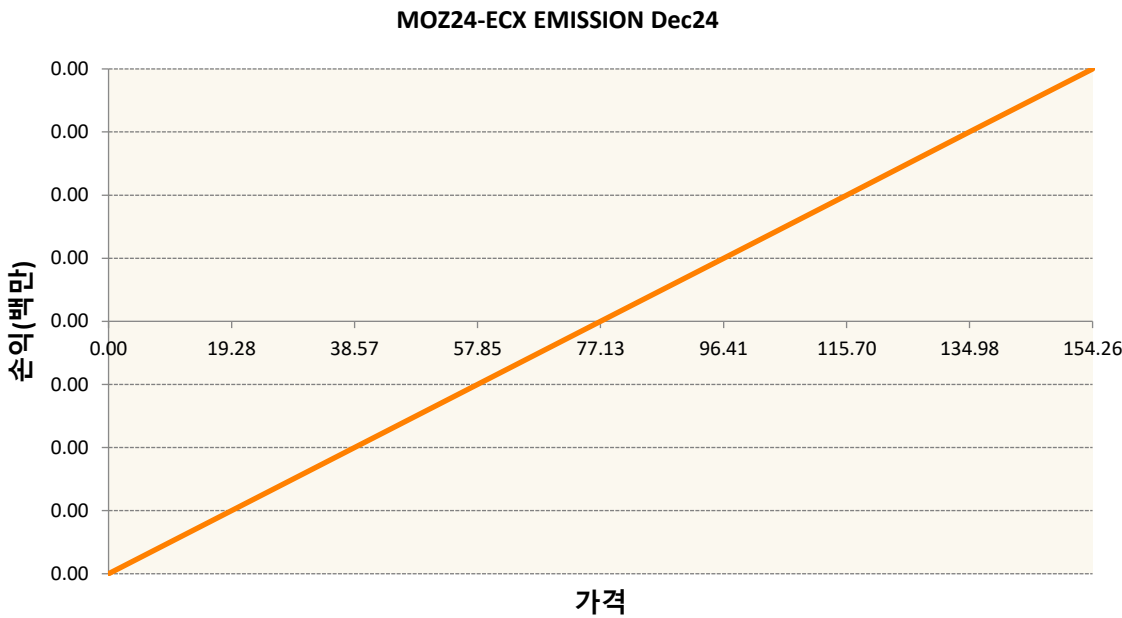
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,367	0	8,367	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	2,873	-2,873	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	116
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	114
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	669
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,361

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,380	0	5,380	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

75

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,424	0	6,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230427(키움)	0.42

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

6

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

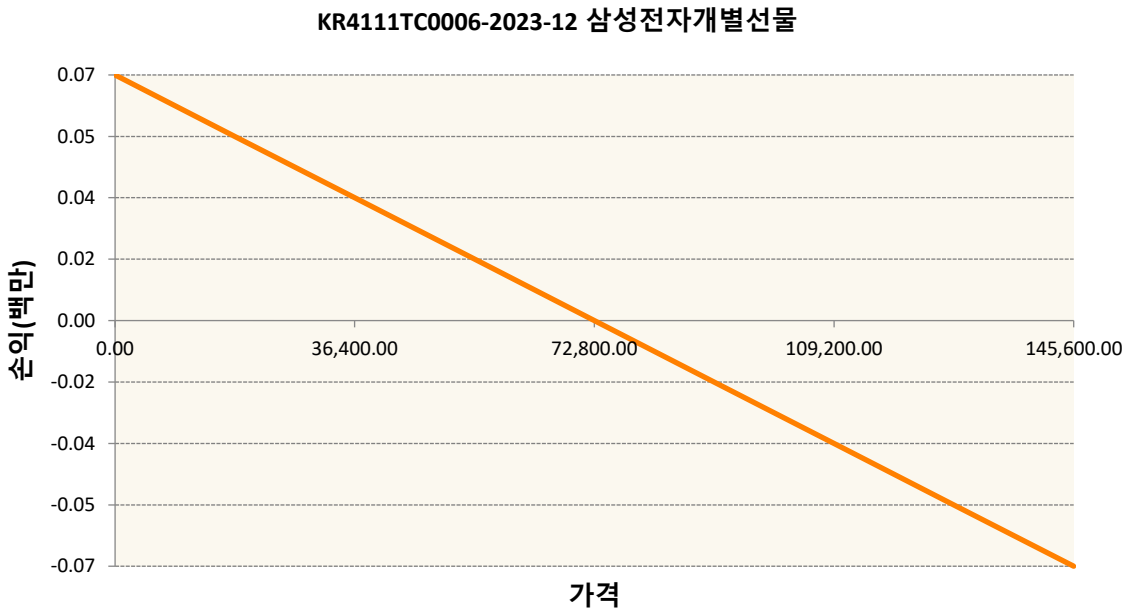
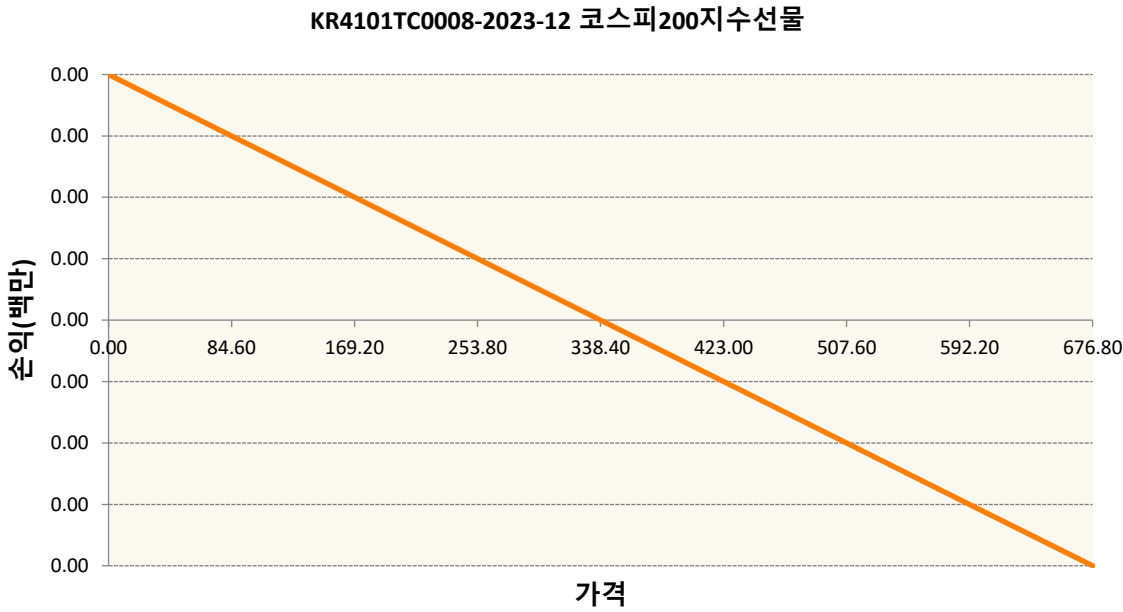
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

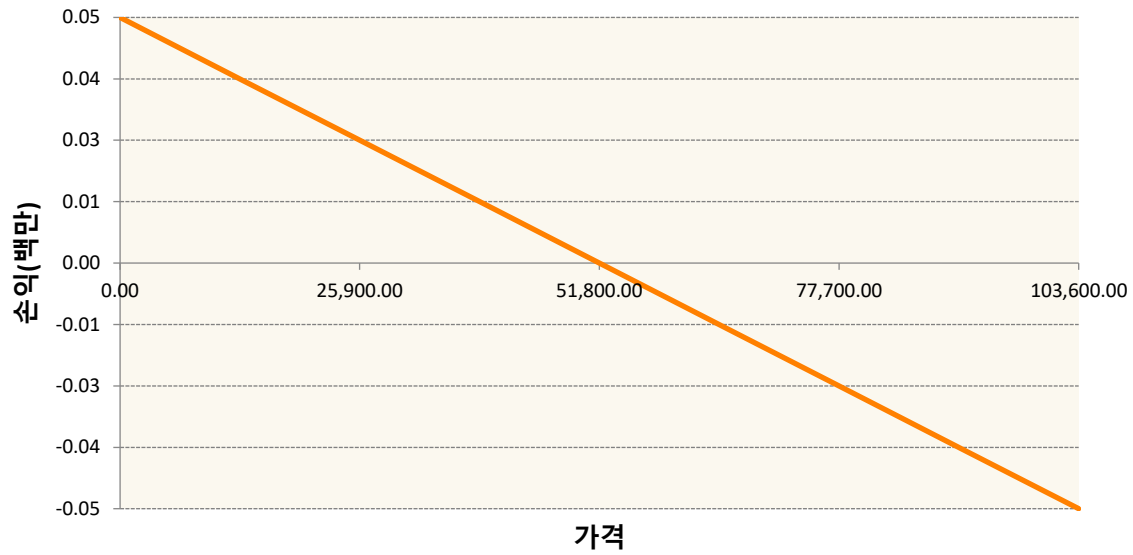
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	232	-232	장내
누계	유가증권	선물	63	3,062	-2,999	장내

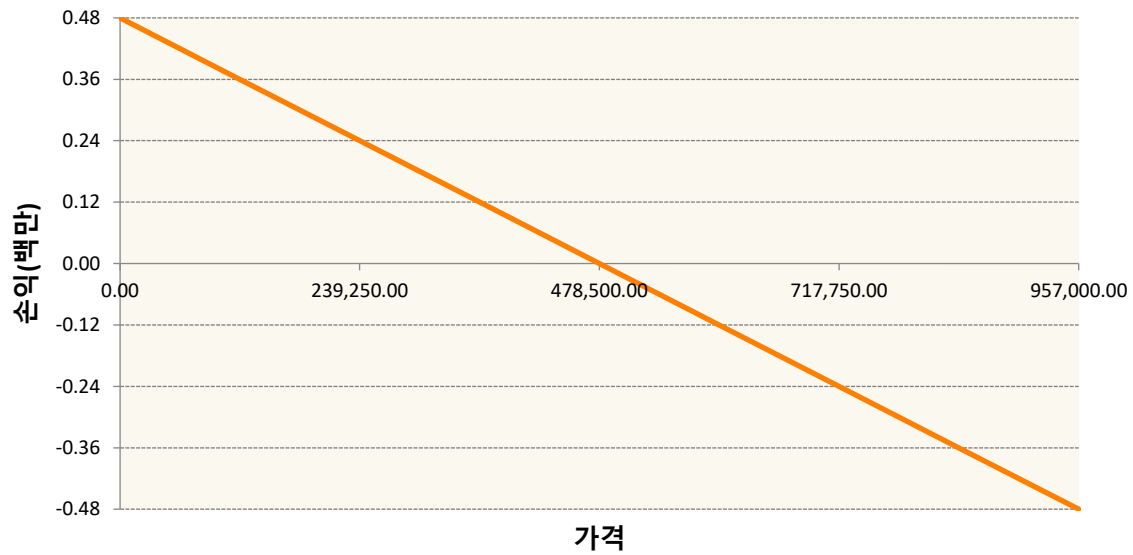
2. 만기시점의 손익구조



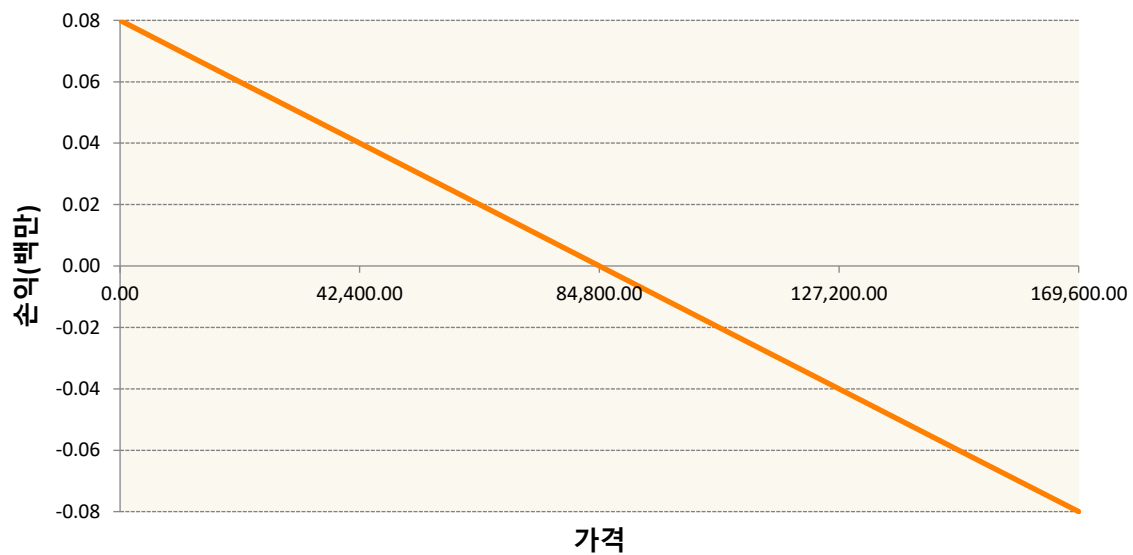
KR4112TC0005-2023-12 SK텔레콤개별선물



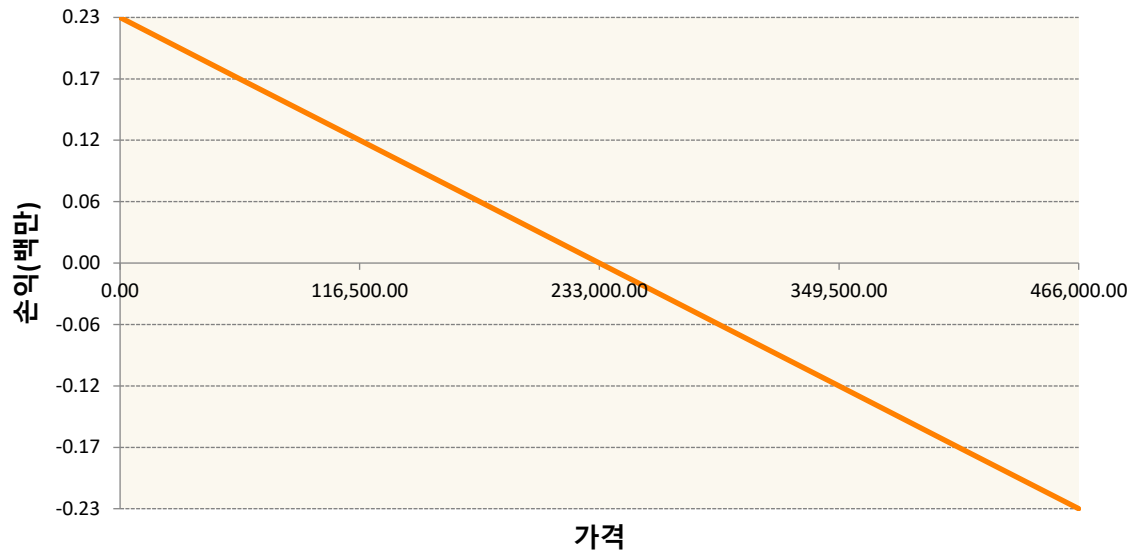
KR4113TC0004-2023-12 POSCO개별선물



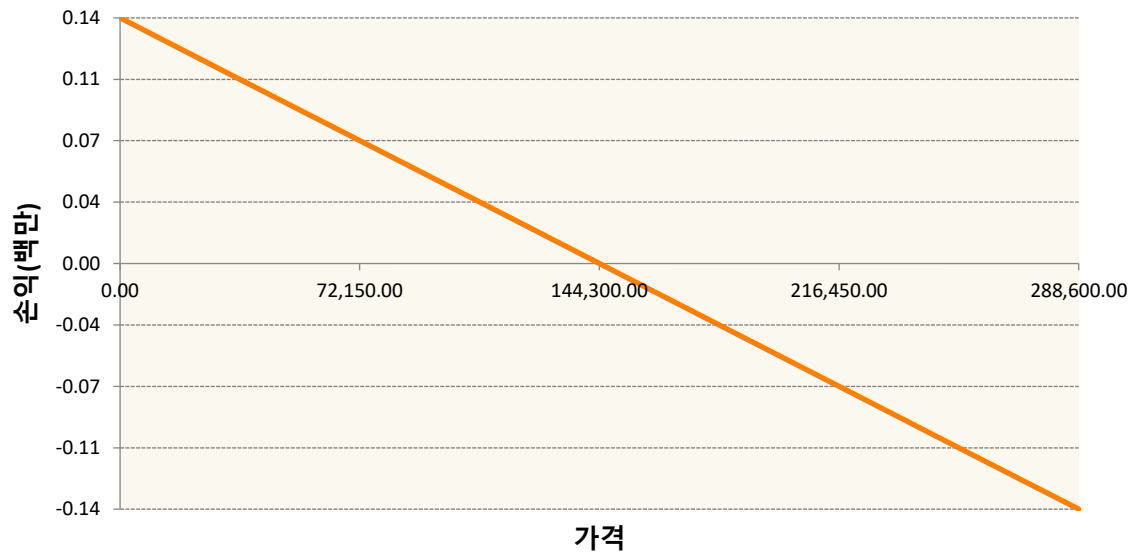
KR4119TC0008-2023-12 기아차개별선물



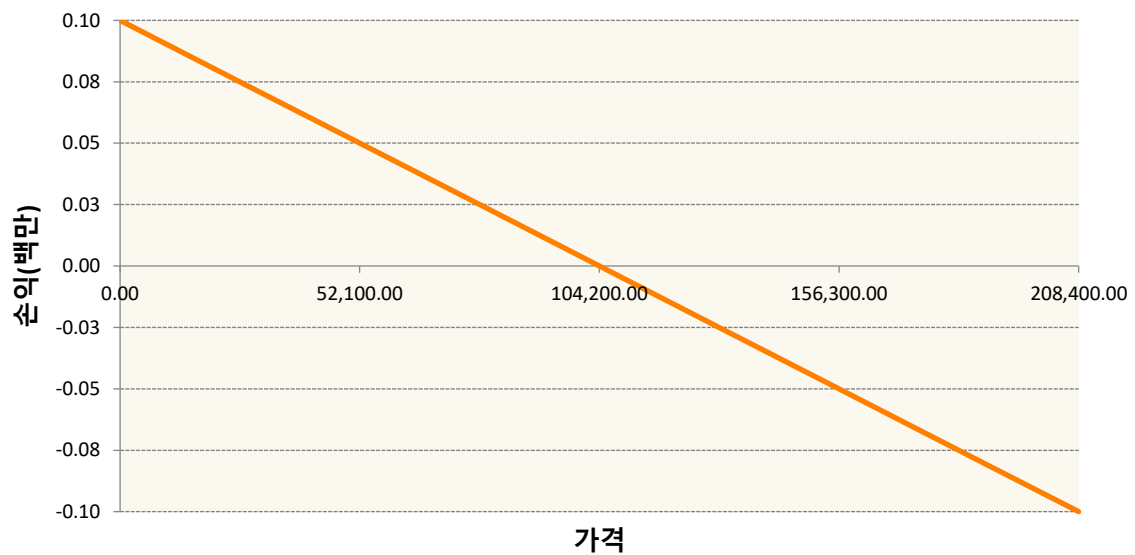
KR4120TC0005-2023-12 현대모비스개별선물



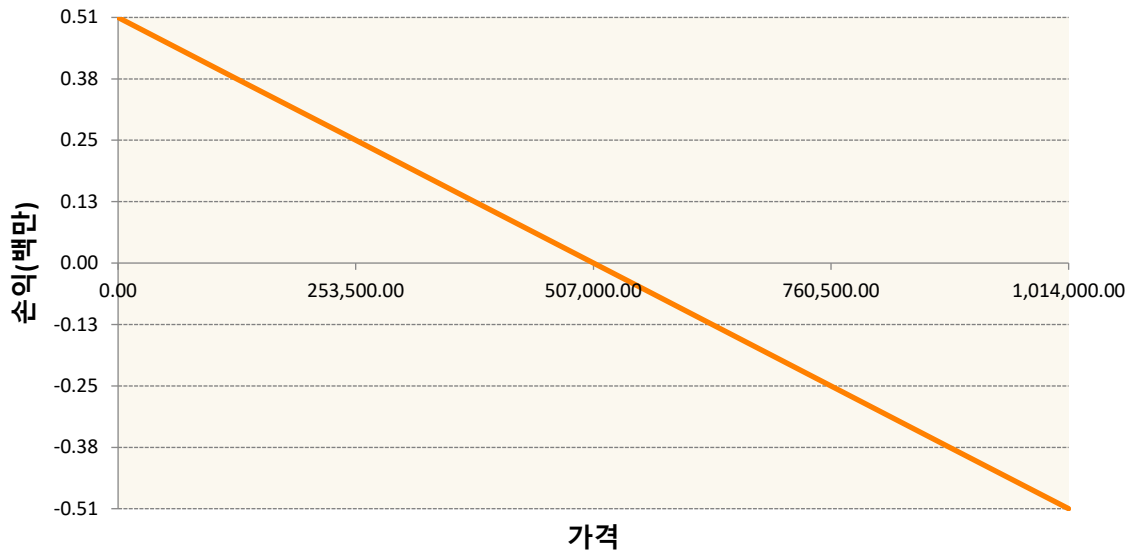
KR4123TC0002-2023-12 삼성전기개별선물



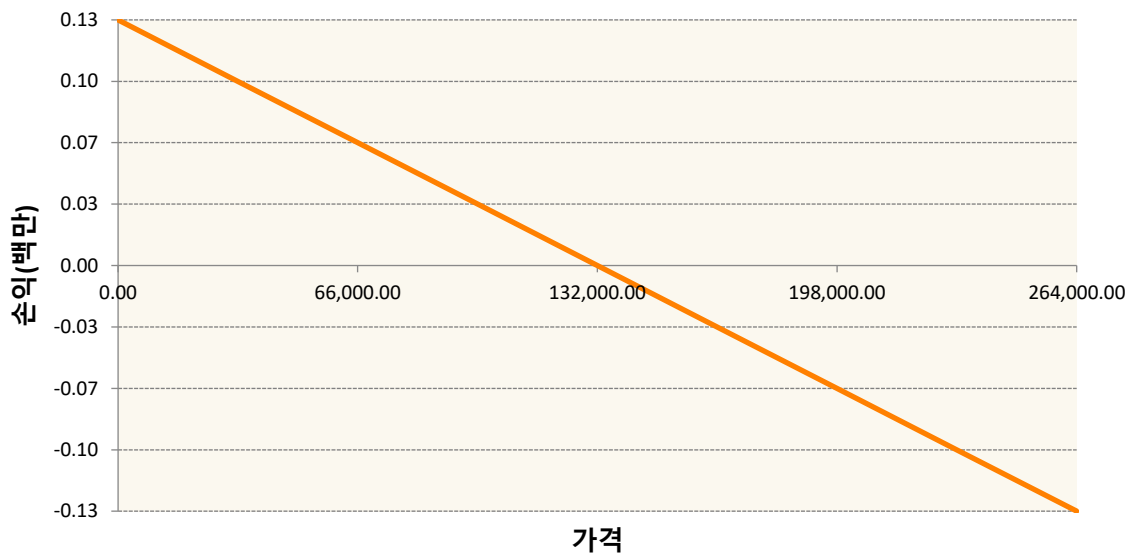
KR4124TC0001-2023-12 LG전자개별선물



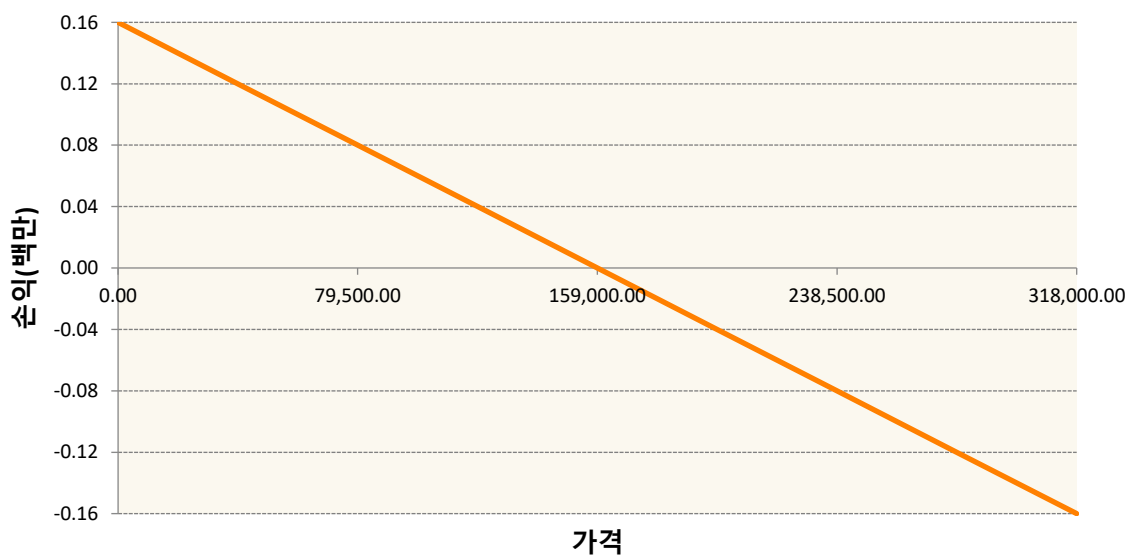
KR4147TC0004-2023-12 LG화학개별선물



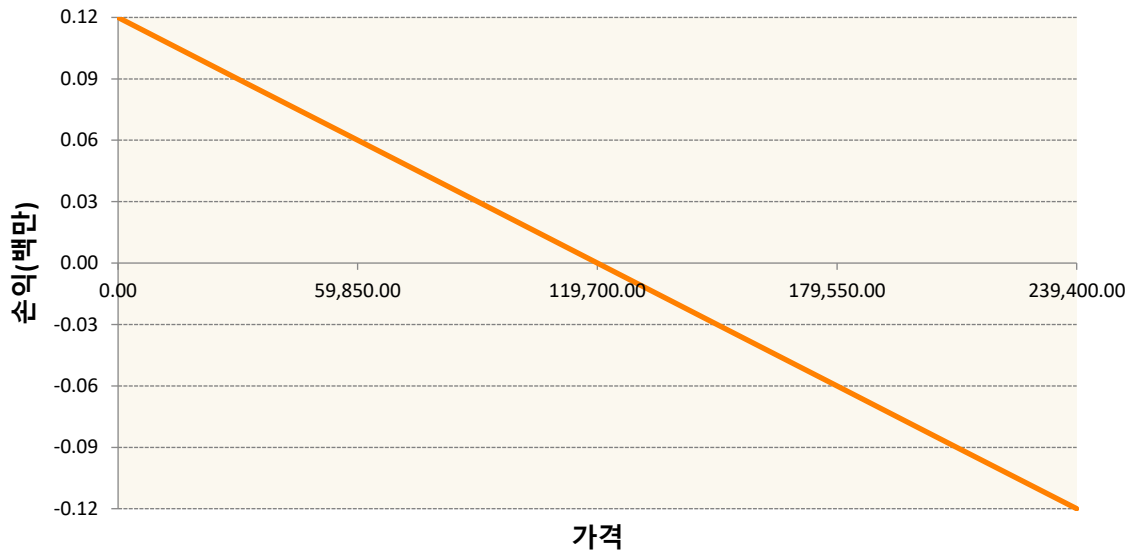
KR4150TC0008-2023-12 SK하이닉스개별선물



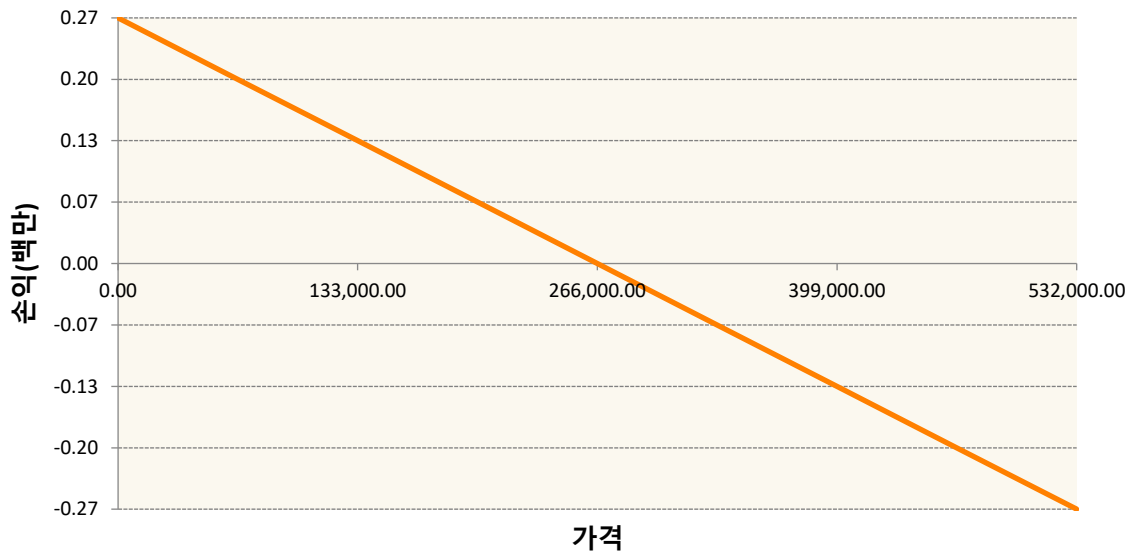
KR41BBTC0003-2023-12 롯데케미칼개별선물



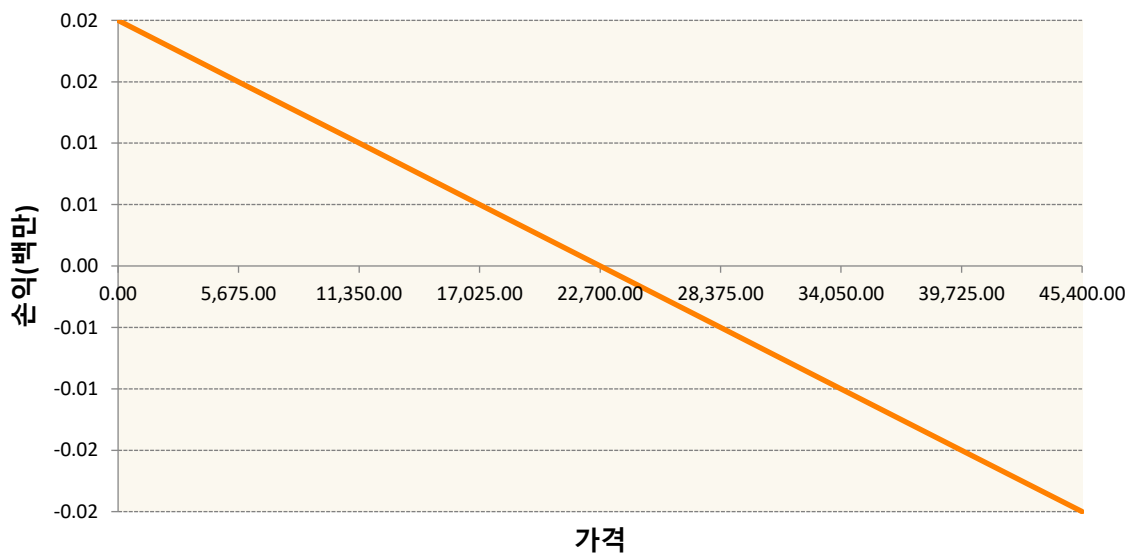
KR41BHTC0007-2023-12 한화에어로스페이스개별선물



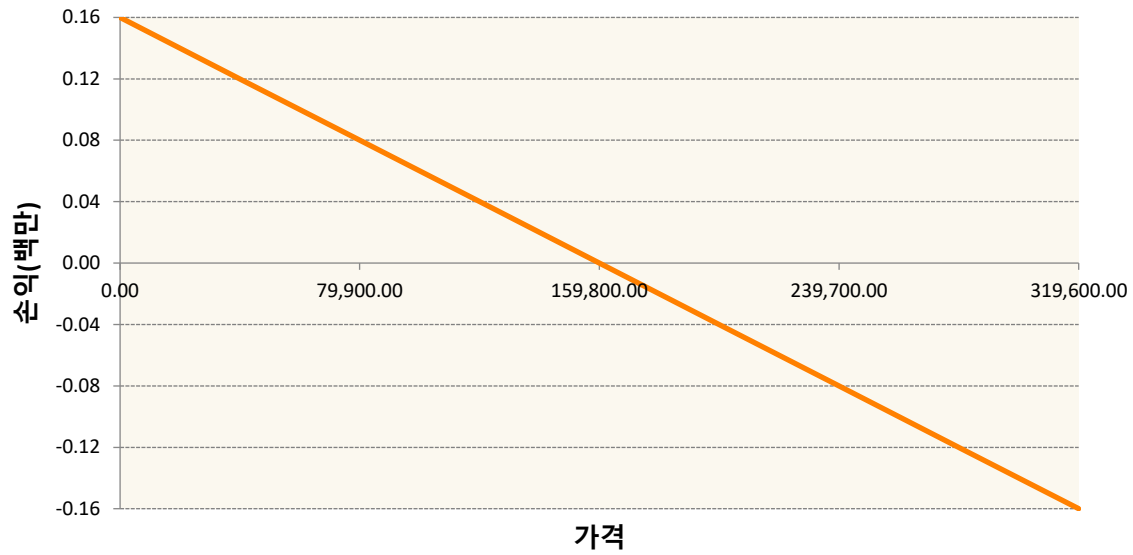
KR41BJTC0005-2023-12 엔씨소프트개별선물



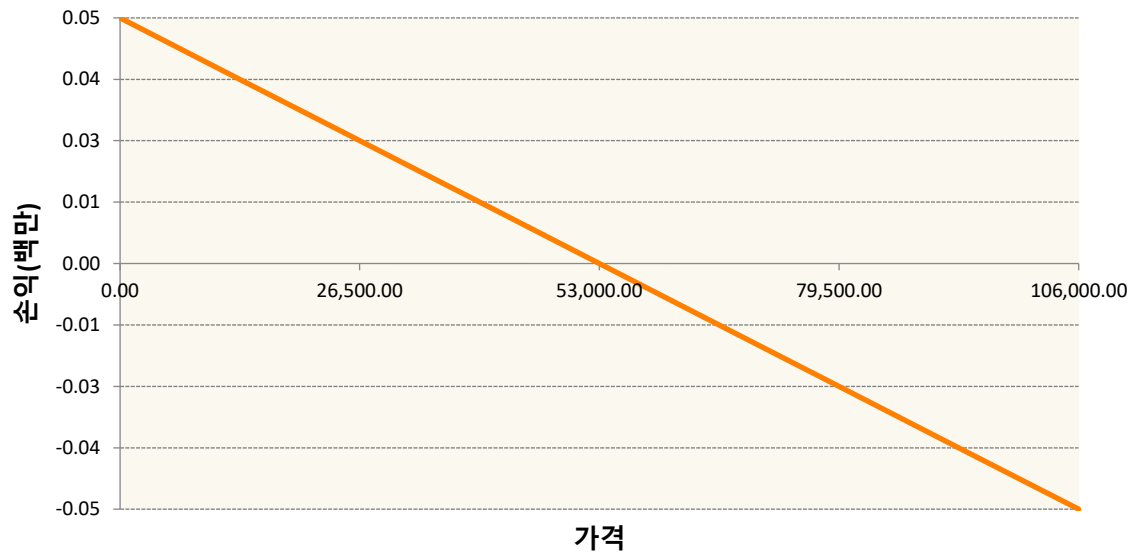
KR41BKTC0002-2023-12 하이트진로개별선물



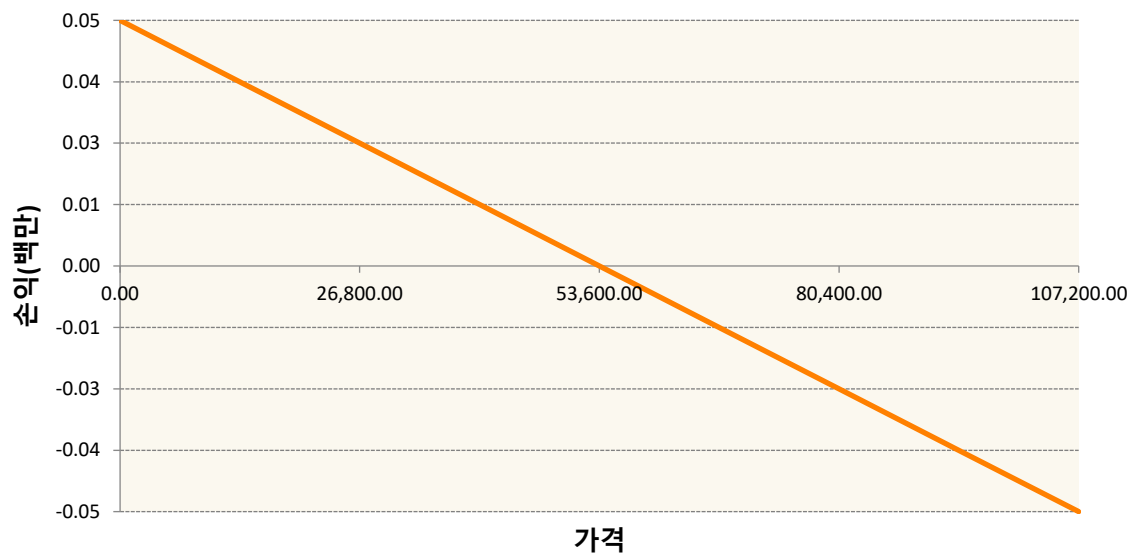
KR41C5TC0008-2023-12 삼성에스디에스개별선물



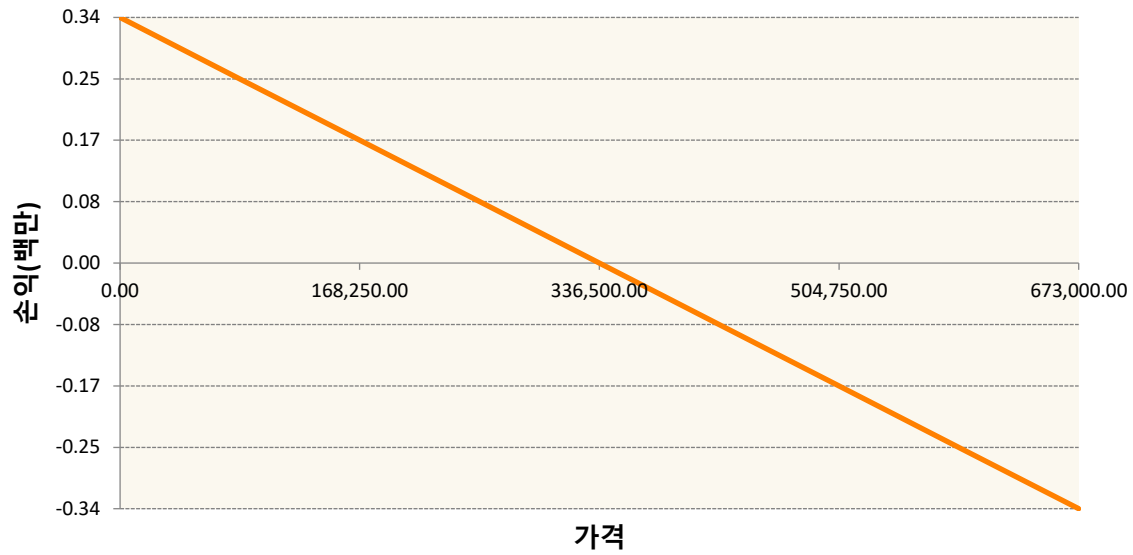
KR41CNTC0008-2023-12 포스코 ICT개별선물



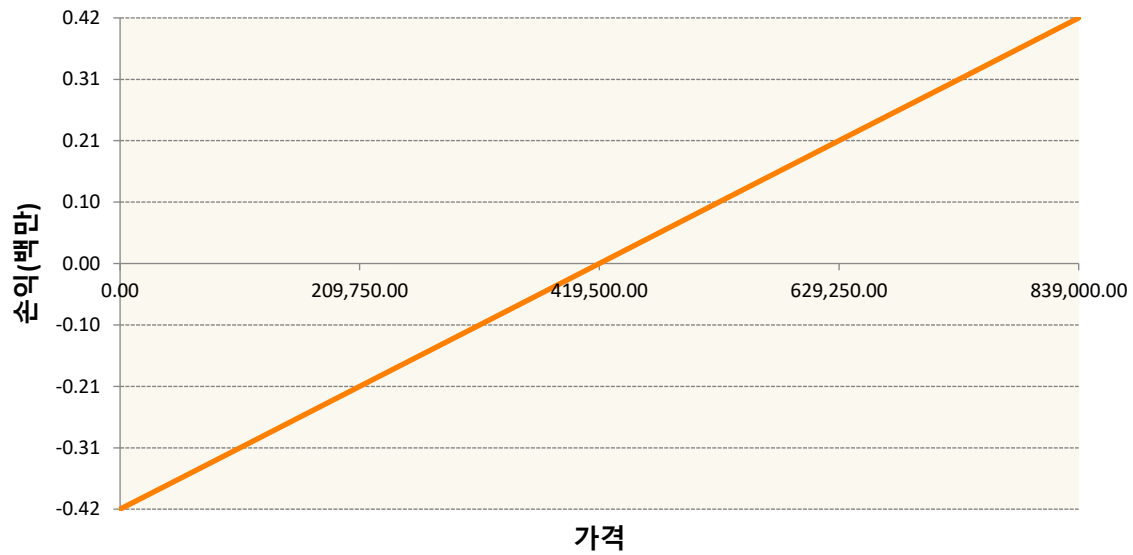
KR41CQTC0005-2023-12 와이지엔터테인먼트개별선물



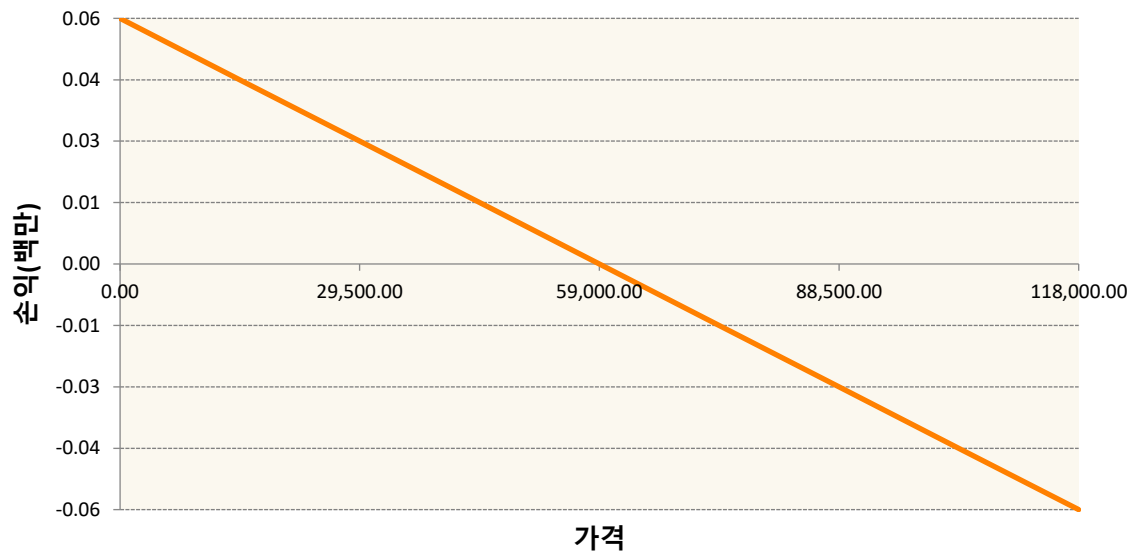
KR41CRTC0004-2023-12 LG생활건강개별선물



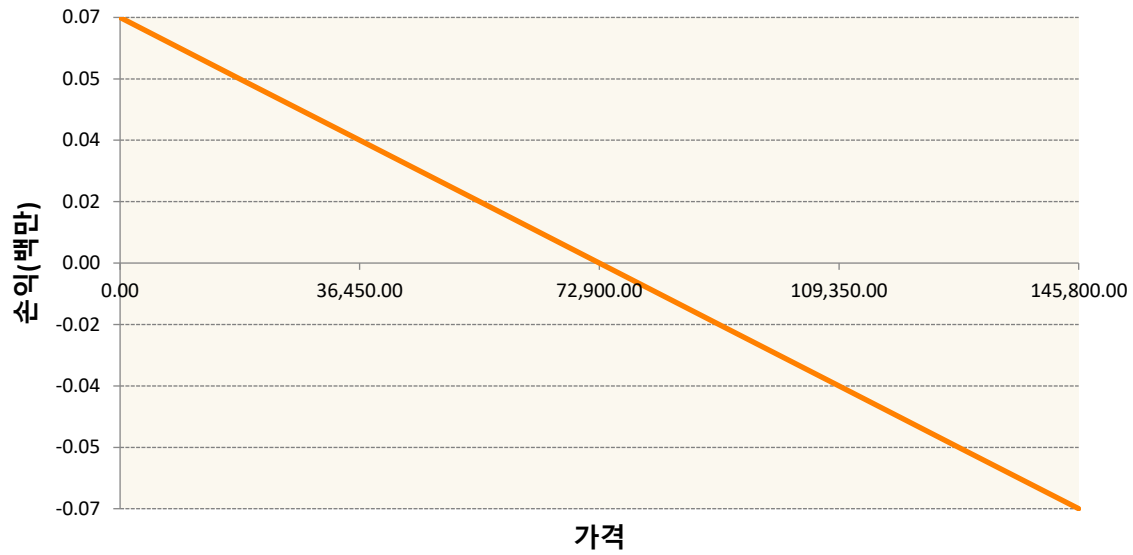
KR41DATC0002-2023-12 농심개별선물



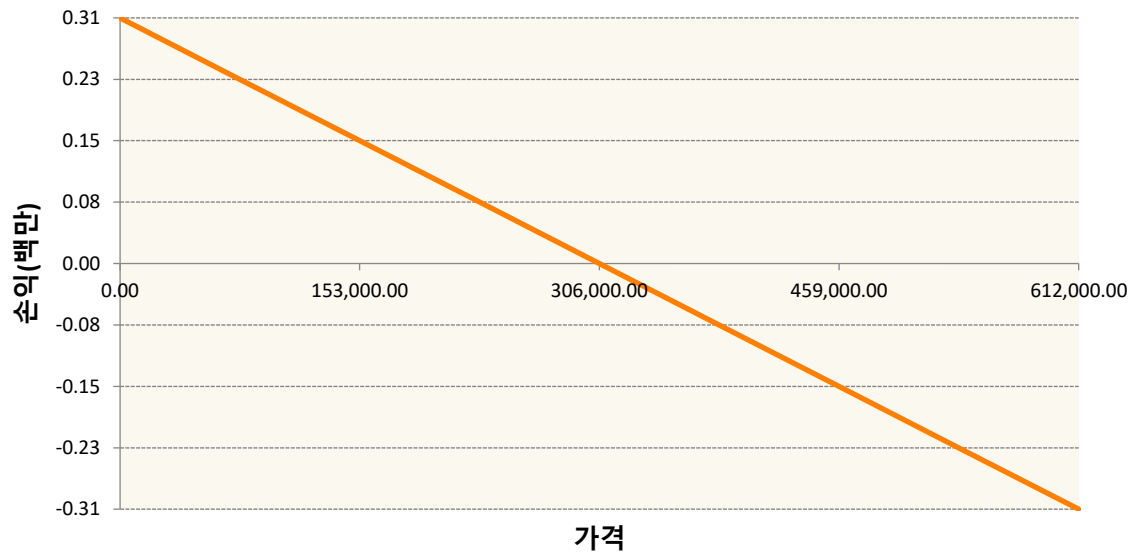
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



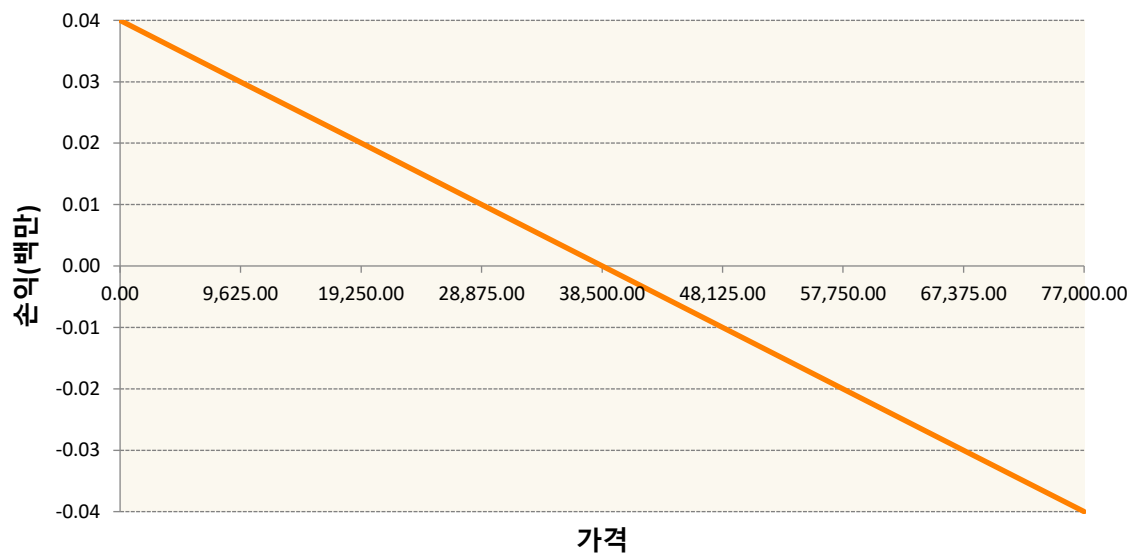
KR41E6TC0003-2023-12 셀트리온헬스케어개별선물



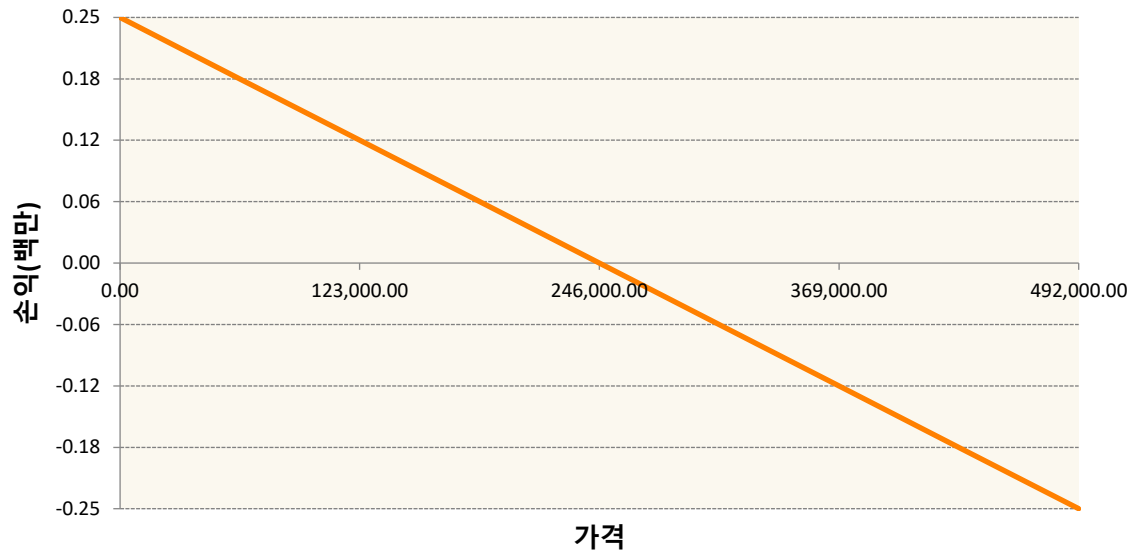
KR41E8TC0001-2023-12 포스코케미칼개별선물



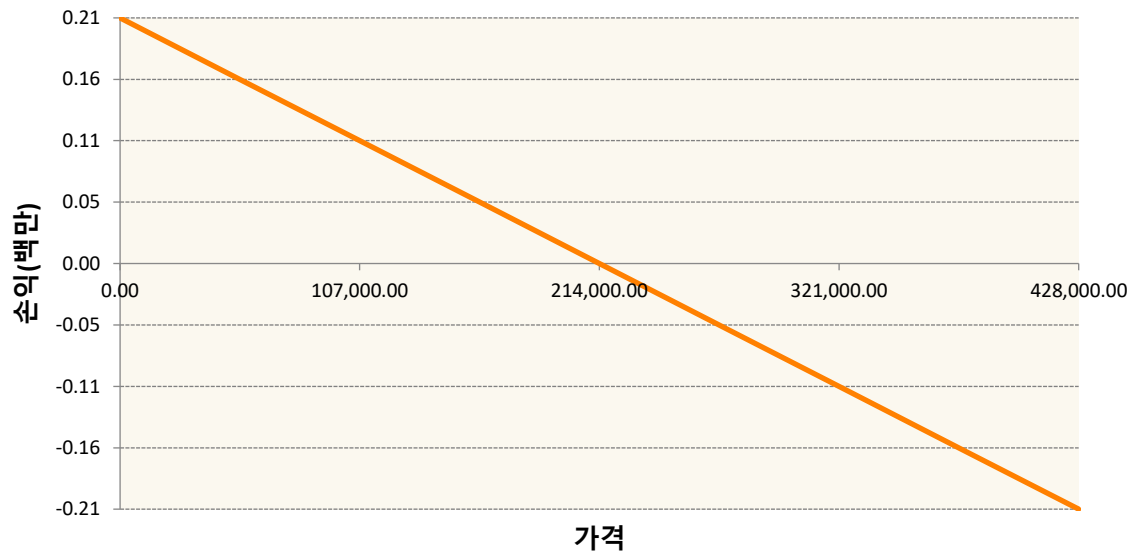
KR41ERTC0002-2023-12 DL이앤씨개별선물



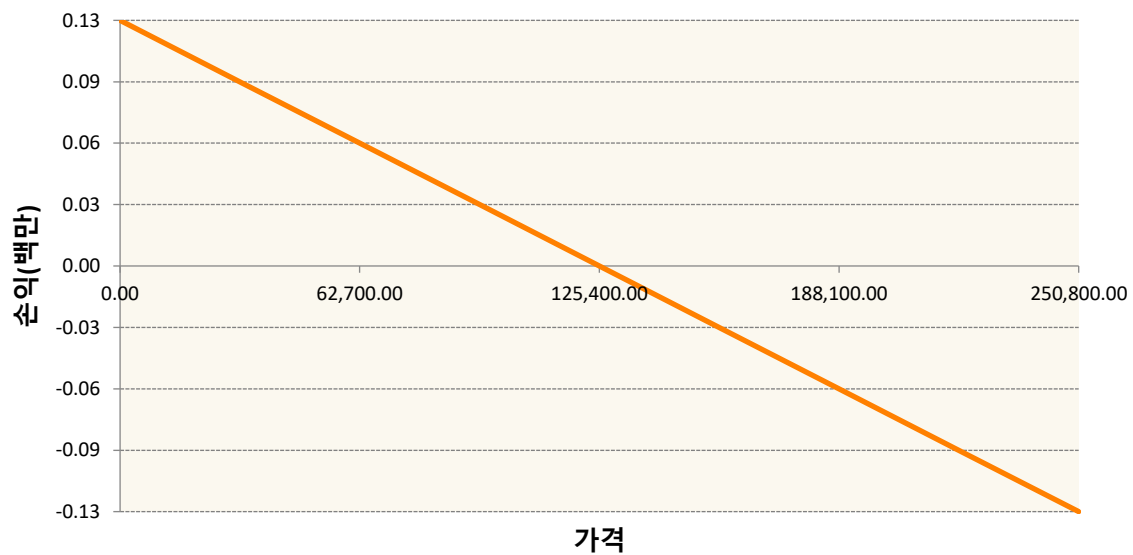
KR41EYTC0003-2023-12 에코프로비엠개별선물



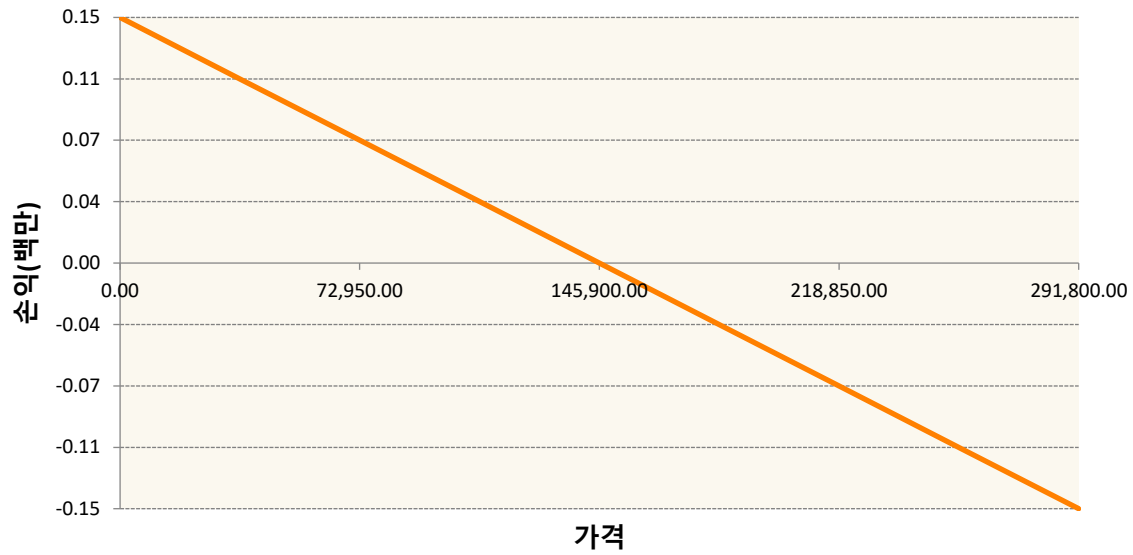
KR41FCTC0008-2023-12 하이브개별선물



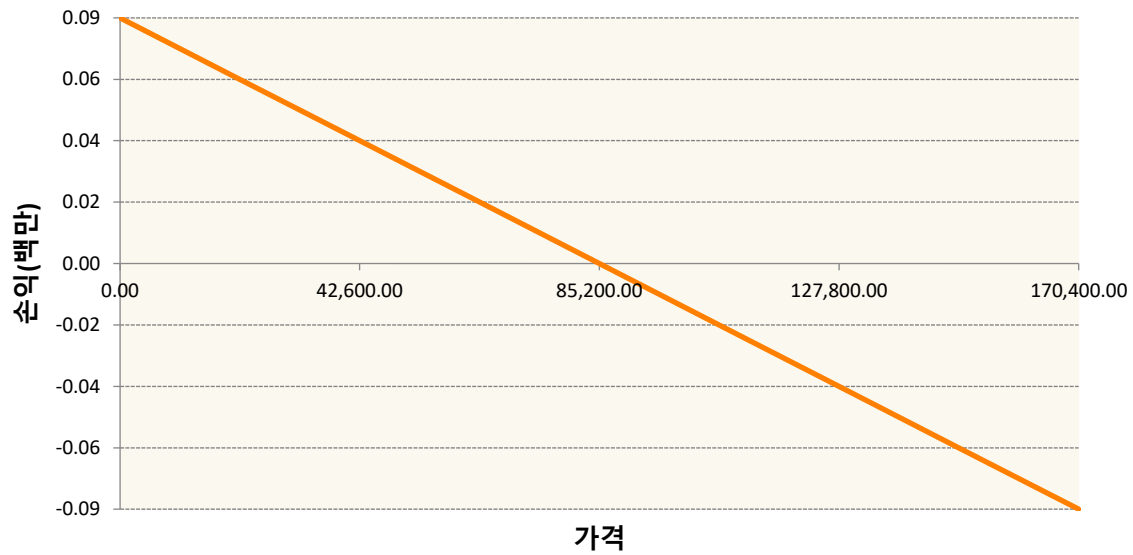
KR41FDTC0007-2023-12 현대중공업개별선물



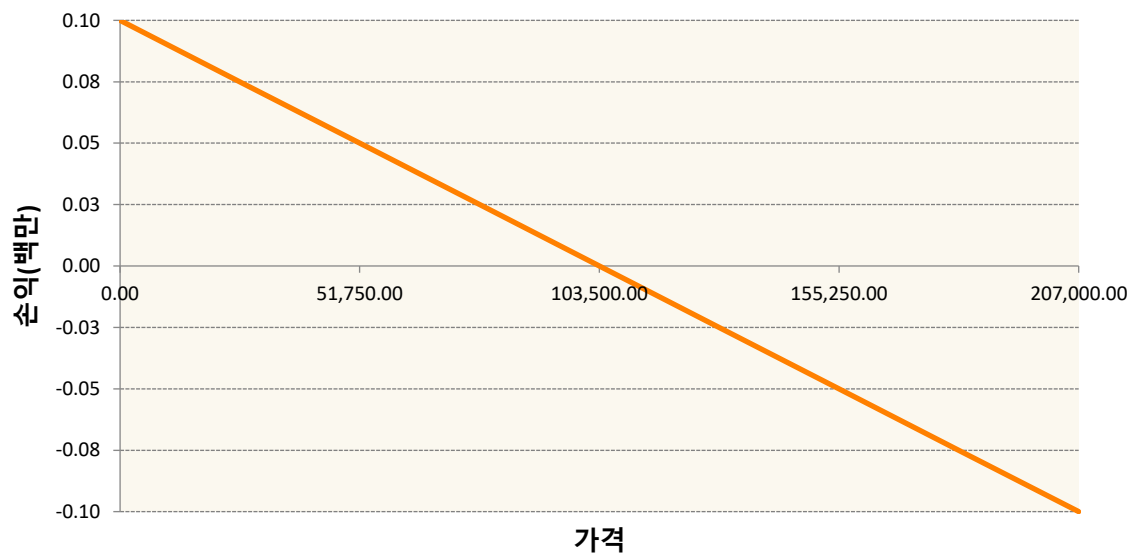
KR41FMTC0006-2023-12 엘애프개별선물



KR41FSTC0000-2023-12 LS개별선물



KR41G1TC0003-2023-12 CJ대한통운개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물	129
KR4111TC00 2023-12 삼성전자개별선물	22
KR4112TC00 2023-12 SK텔레콤개별선물	4
KR4113TC00 2023-12 POSCO개별선물	1
KR4119TC00 2023-12 기아차개별선물	3
KR4120TC00 2023-12 현대모비스개별선물	2
KR4123TC00 2023-12 삼성전기개별선물	1
KR4124TC00 2023-12 LG전자개별선물	2
KR4147TC00 2023-12 LG화학개별선물	3
KR4150TC00 2023-12 SK하이닉스개별선물	19
KR41BBTC00 2023-12 롯데케미칼개별선물	2
KR41BHTC00 2023-12 한화에어로스페이스개별선물	4
KR41BJTC00 2023-12 엔씨소프트개별선물	7
KR41BKTC00 2023-12 하이트진로개별선물	5
KR41C5TC00 2023-12 삼성에스디에스개별선물	4
KR41CNTC00 2023-12 포스코 ICT개별선물	1
KR41CQTC00 2023-12 와이지엔터테인먼트개별선물	2
KR41CRTC00 2023-12 LG생활건강개별선물	3
KR41DATC00 2023-12 농심개별선물	5
KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물	6
KR41E6TC00 2023-12 셀트리온헬스케어개별선물	2
KR41E8TC00 2023-12 포스코케미칼개별선물	4
KR41ERTC00 2023-12 DL이앤씨개별선물	2
KR41EYTC00 2023-12 에코프로비엠개별선물	4
KR41FCTC00 2023-12 하이브개별선물	5
KR41FDTC00 2023-12 현대중공업개별선물	2
KR41FMTC00 2023-12 엘앤에프개별선물	2
KR41FSTC00 2023-12 LS개별선물	1
KR41G1TC00 2023-12 CJ대한통운개별선물	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

367

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

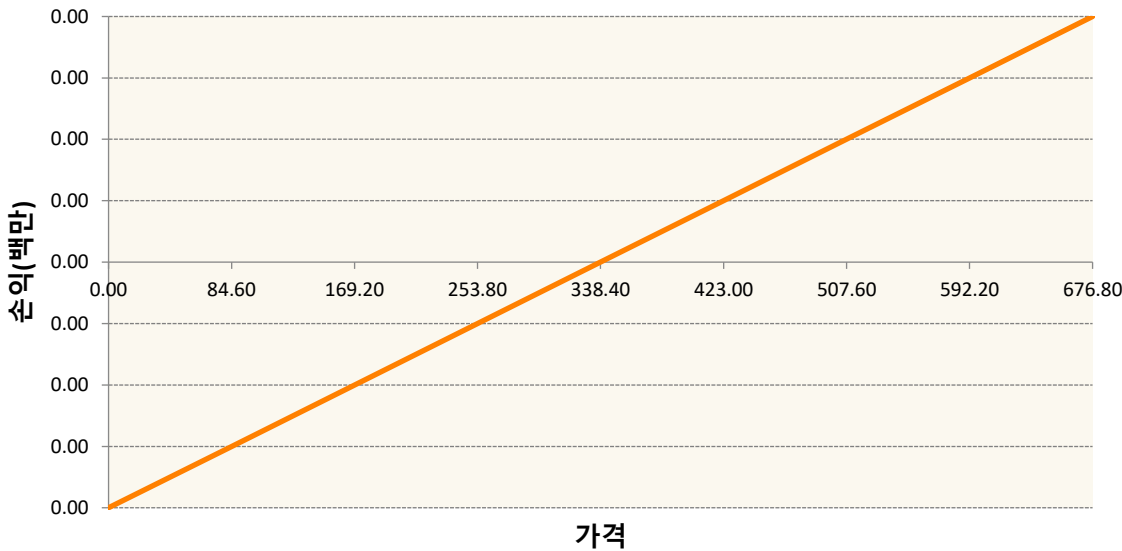
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,399	0	4,399	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101TC0008-2023-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC0008		2023-12 코스피200지수선물					351
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351
-5.33%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-2.67%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	117	117	117	117	117	117	117
5.33%	234	234	234	234	234	234	234
8.00%	351	351	351	351	351	351	351

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

330

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

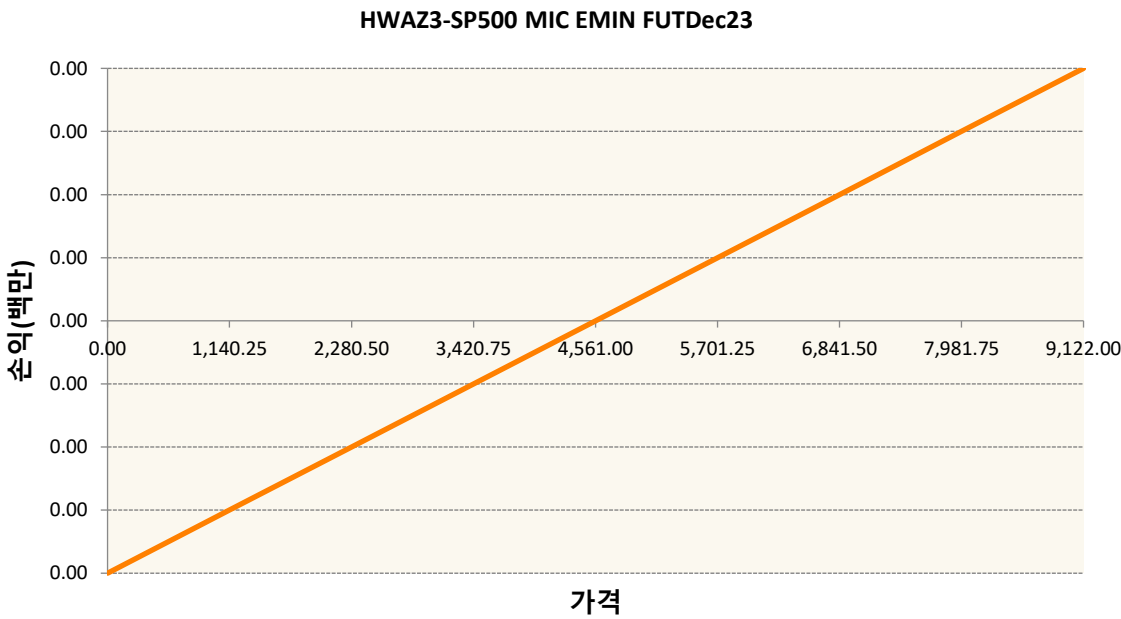
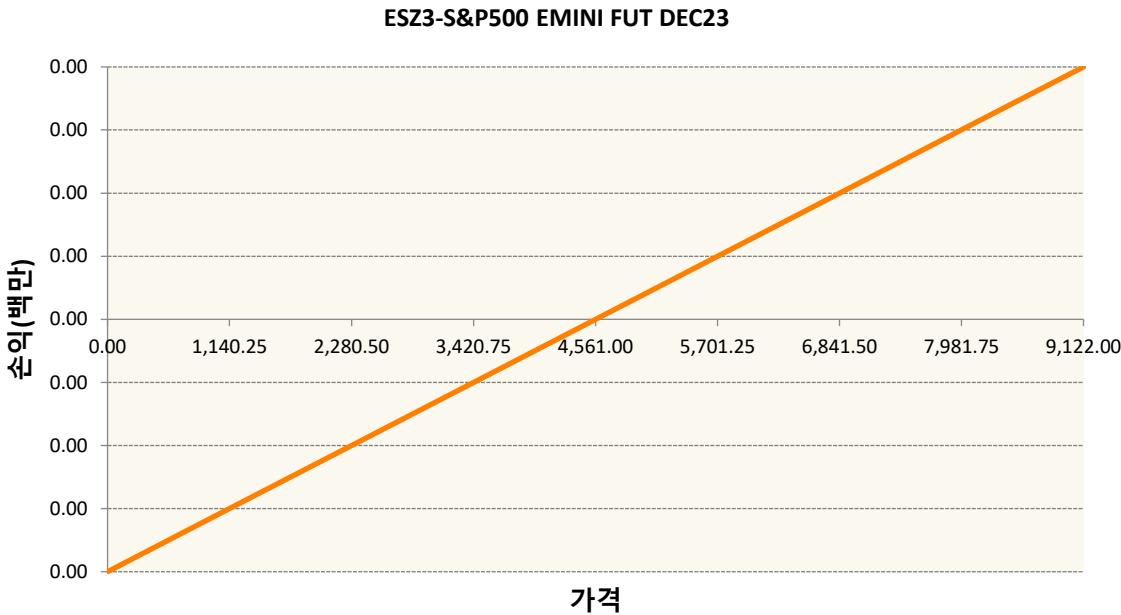
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	308	0	308	
누계	유가증권	선물	1,835	0	1,835	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ3	S&P500 EMINI FUT DEC23	25
HWAZ3	SP500 MIC EMIN FUTDec23	147

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	147

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

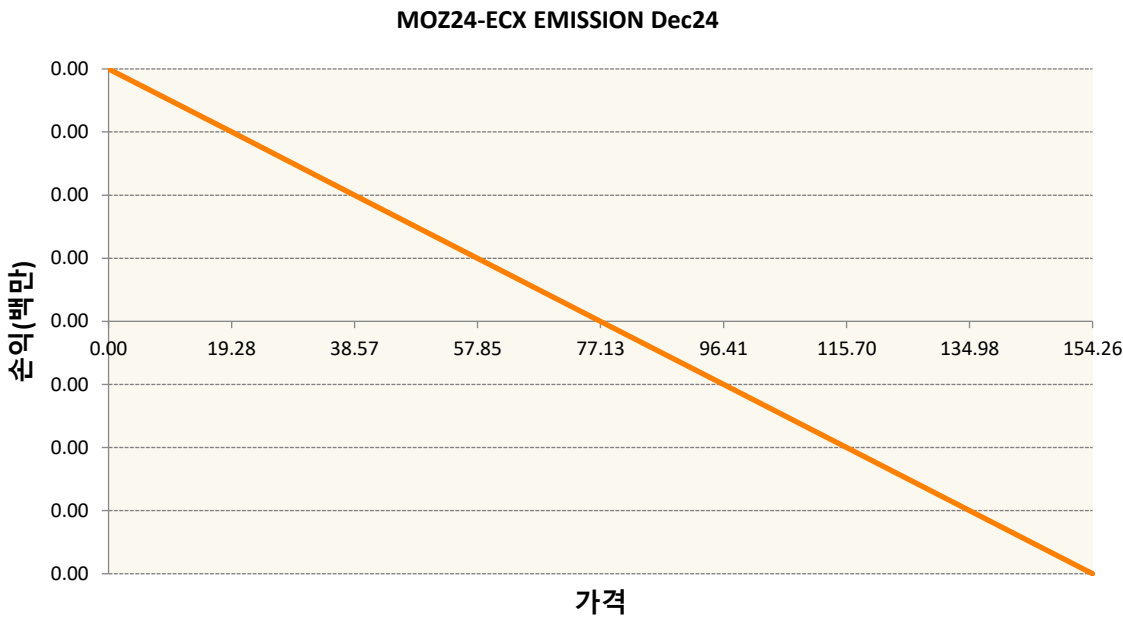
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	5,900	-5,900	
누계	지수	스왑	479	0	479	장외
누계	통화	선도	0	3,946	-3,946	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	49
FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E	130
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	7
FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E	130
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	472
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

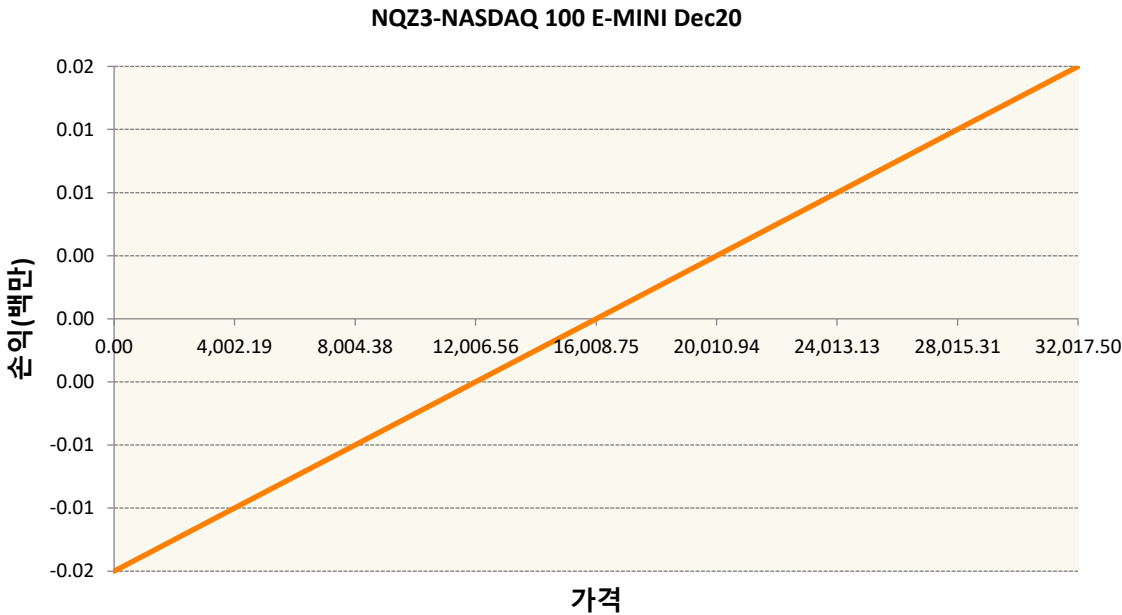
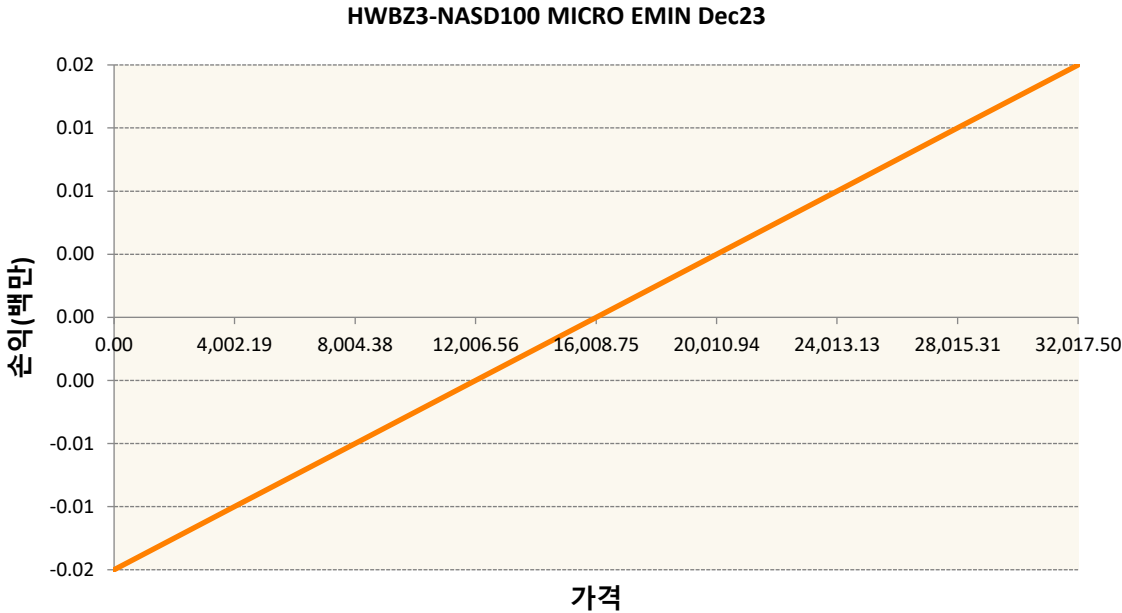
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	432	0	432	
누계	유가증권	선물	1,467	0	1,467	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ3	NASD100 MICRO EMIN Dec23		117
NQZ3	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		35

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			140

공시일	2023-11-29
기준일	2023-11-28

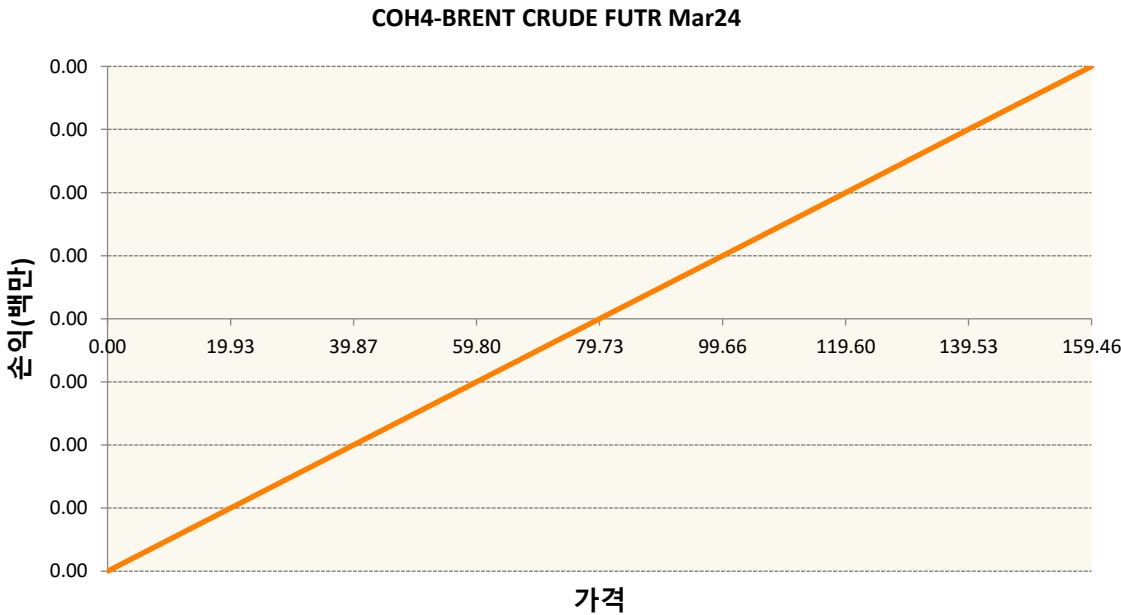
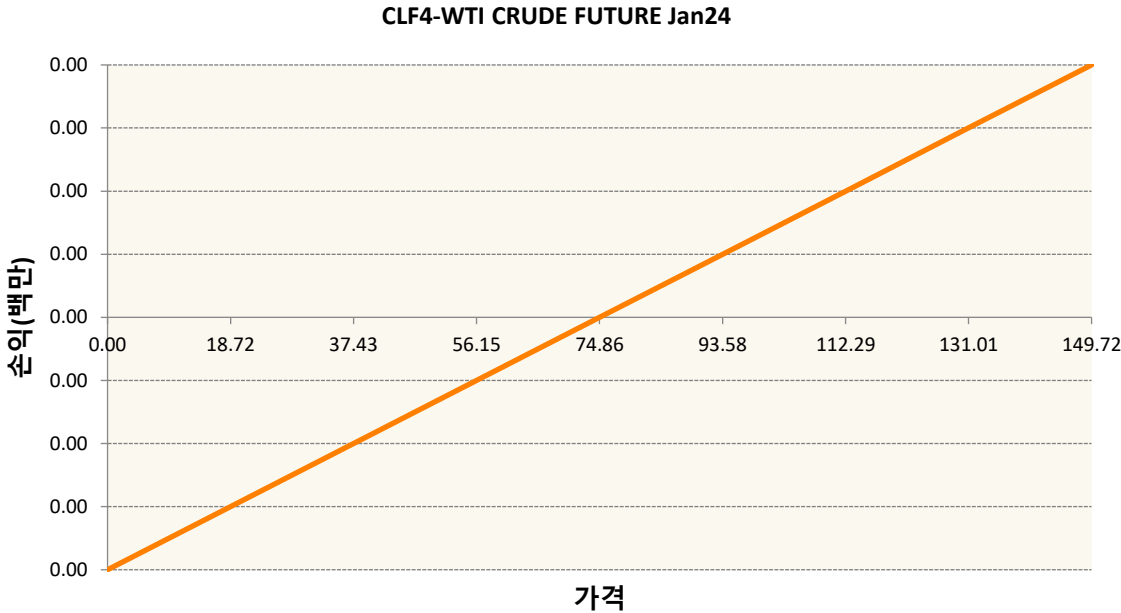
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

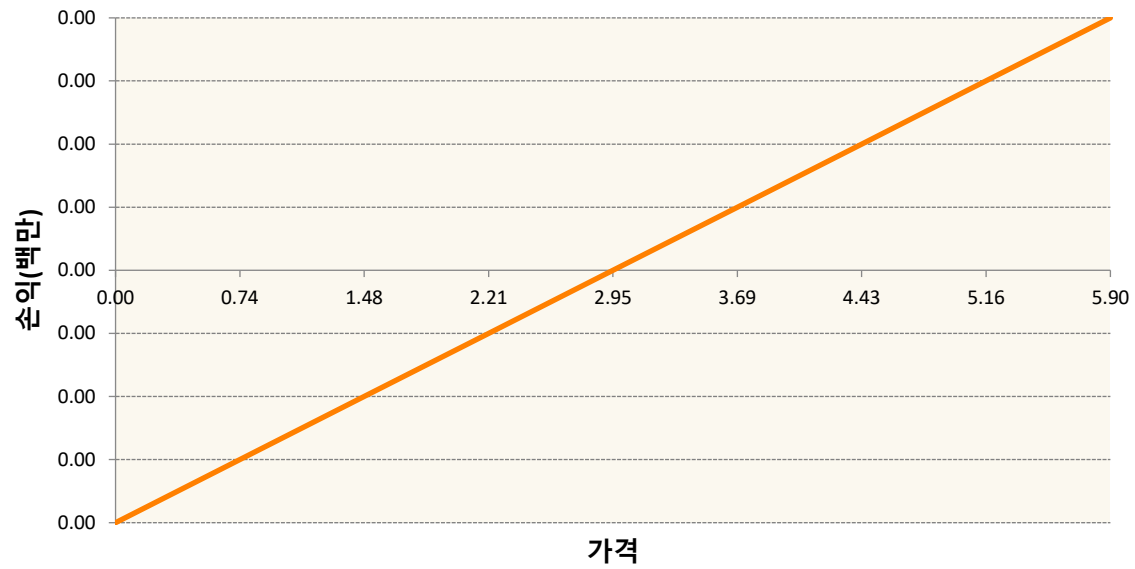
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,268	0	1,268	
누계	통화	선물	0	142	-142	장내

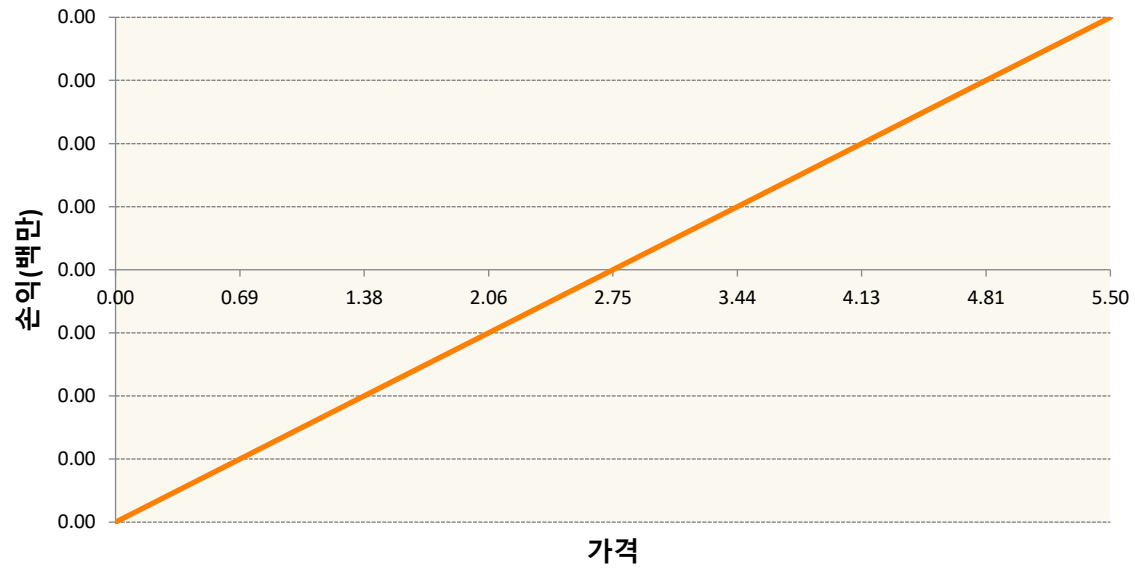
2. 만기시점의 손익구조



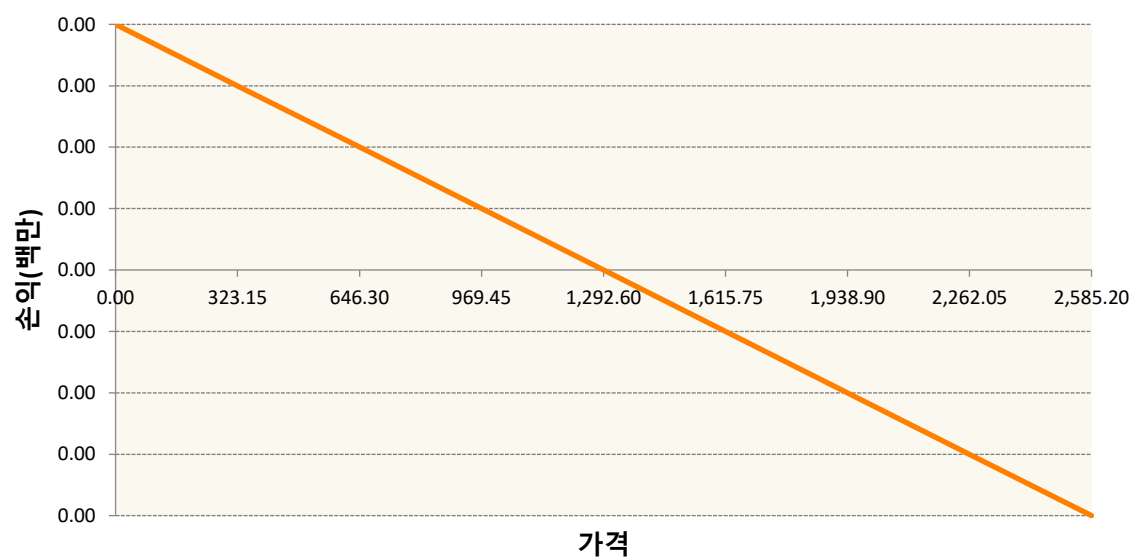
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



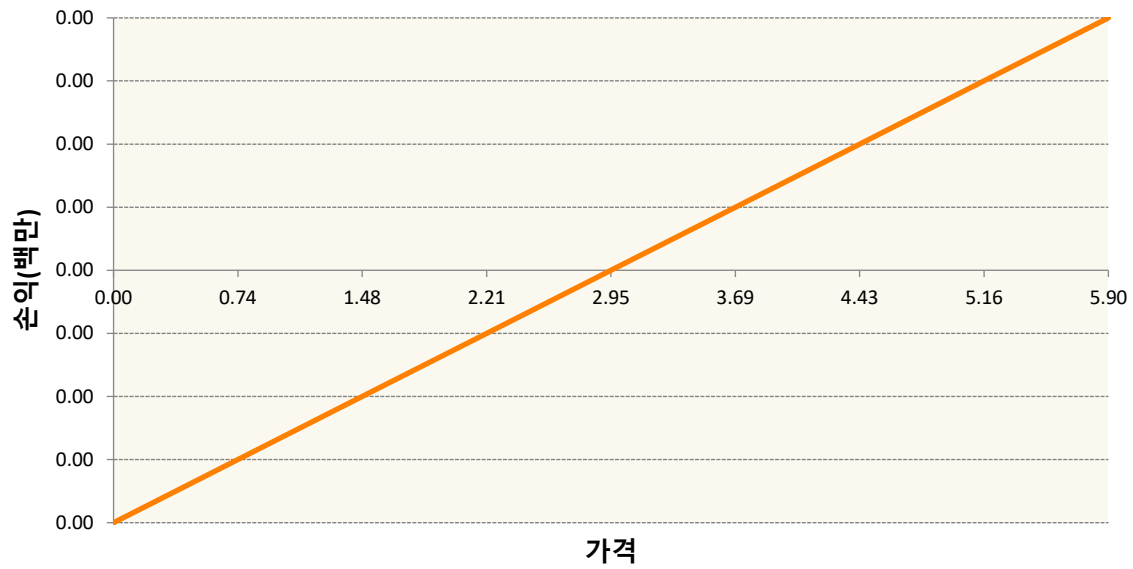
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



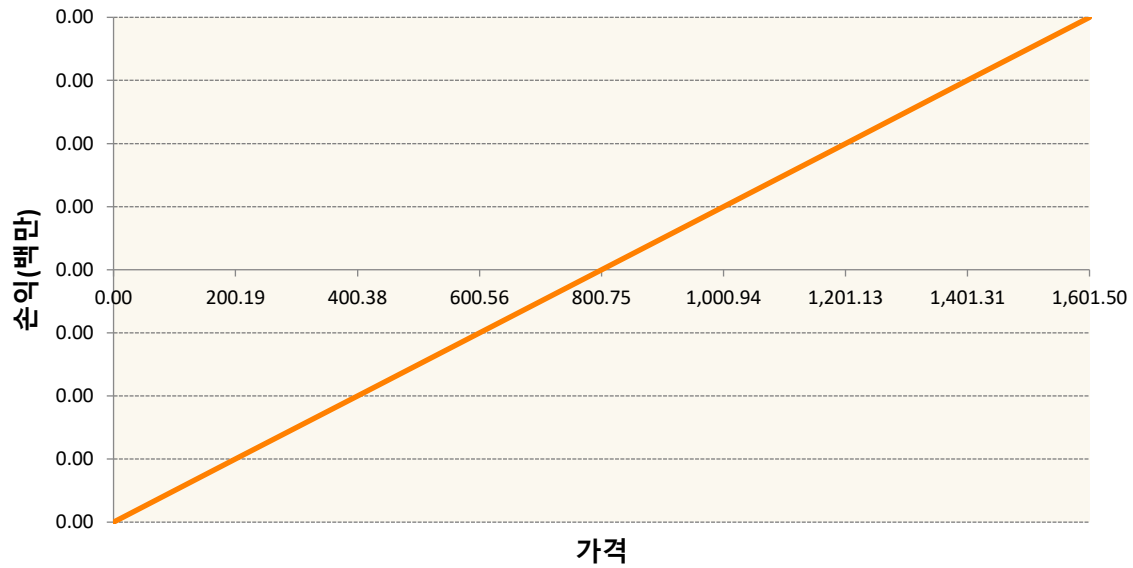
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



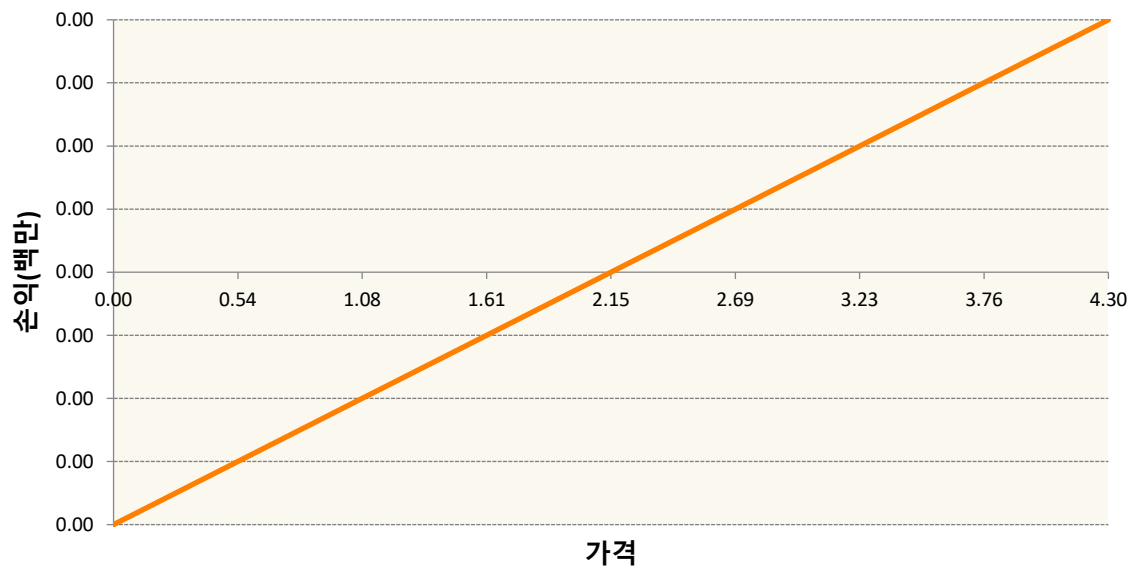
NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24



XBF4-GASOLINE RBOB FUT Jan24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF4	WTI CRUDE FUTURE Jan24	24
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	25
EOF4	E-MINI NATURAL GAS Jan24	2
HOF4	NY Harb ULSD Fut Jan24	12
KR4175TC00	2023-12 달러선물	11
NGF24	NATURAL GAS FUTR Jan24	19
QSF4	Low Su Gasoil G Jan24	9
XBF4	GASOLINE RBOB FUT Jan24	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

253